NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

(Eine in Irland gegründete Umbrella-Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und beschränkter Haftung, deren Fonds getrennt haften. Eingetragen unter der Registrierungsnummer 267219)

JAHRESBERICHT UND

GEPRÜFTER JAHRESABSCHLUSS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Fondsanteile sollten nicht allein auf Grundlage des Finanzberichts gezeichnet werden. Zeichnungen sollten nur auf Basis des aktuellen Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem jüngsten Halbjahresbericht, falls dieser aktueller ist, erfolgen.

Die angegebene Performance gibt die frühere Wertentwicklung wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Inhalt **Seite**

Organisation 4

Informationen zur Gesellschaft 6

Bericht des Portfolioverwalters 18

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber 25

Bericht des Verwaltungsrats 26

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer 31

Bruttobeträge 36

Gesamterfolgsrechnung 38

Entwicklung des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens 40

Kapitalflussrechnung 42

Erläuterungen zum Jahresabschluss per 31. Dezember 2023 44

Vermögensaufstellung 126
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Multisector Income Fund 126
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles High Income Fund 146
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund 161
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund 172
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro High Yield Fund 196
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro Credit Fund 204
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund 216

Entwicklung der Portfoliozusammensetzung (ungeprüft) 227
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Multisector Income Fund 227
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles High Income Fund 229
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund 231
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund 233
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro High Yield Fund 235
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro Credit Fund 237
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund 239

Anhang I – Vergütungspolitik (ungeprüft) 241

Anhang II – Offenlegung der Vergütungen (ungeprüft) 244

Anhang III – Angaben zur Wertentwicklung (ungeprüft) 246

Anhang IV – Angaben gemäß der Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) 253

Anhang V – Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) 254

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Organisation

Verwaltungsrat*

Daniel Morrissey (Irland)**
Jason Trepanier (USA)**+
Lynda Wood (geb. Schweitzer) (USA)***
John Nolan (Irland)**
Christopher Yiannakou (UK)****

* siehe Bericht des Verwaltungsrats – Erklärung zur Unternehmensführung und Zusammensetzung des Verwaltungsrats
** Vom Anlageverwalter unabhängiges Verwaltungsratsmitglied
*** Geschäftsführer des Anlageverwalters
**** Geschäftsführerin von Loomis Sayles Investments Limited, UK (eine hundertprozentige Tochtergesellschaft des Portfolioverwalters)
\+ Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft und Promoter und Vertriebsstelle

Verwaltungsgesellschaft und Promoter

Natixis Investment Managers S.A.
(bis 31. März 2024)
2, rue Jean Monnet
L-2180 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Natixis Investment Managers International *(ab 1. April 2024)*
43, avenue Pierre Mendès-France
75013 Paris
Frankreich

Eingetragener Geschäftssitz

6th Floor
2 Grand Canal Square
Dublin
D02 A342
Irland

Vertriebsstelle

Natixis Investment Managers International
43, avenue Pierre Mendès-France
75013 Paris
Frankreich

Verwaltungs-, Register- und Transferstelle

Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin
D02 W329
Irland

Portfolioverwalter

Loomis, Sayles & Company, L.P. [(1)]
One Financial Center
Boston
Massachusetts 02111
USA

Loomis Sayles (Netherlands) B.V. [(2)]
Stadsplateau 7
3521 AZ Utrecht
Niederlande

Verwahrstelle

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street
Dublin
D02 W329
Irland

Rechtsberater der Gesellschaft

William Fry LLP
2 Grand Canal Square
Dublin
D02 A342
Irland

[(1)] Bis zum 31. März 2024 für den Loomis Sayles Euro High Yield Fund, den Loomis Sayles Euro Credit Fund und den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

[(2)] Ab dem 1. April 2024 für den Loomis Sayles Euro High Yield Fund, den Loomis Sayles Euro Credit Fund und den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

Organisation (Fortsetzung)

Secretary

Wilton Secretarial Limited
6th Floor
2 Grand Canal Square
Dublin
D02 A342
Irland

Unabhängige Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants & Registered Auditors
One Spencer Dock
International Financial Services Centre
Dublin
D01 X9R7
Irland

Vertreter in Hongkong

Brown Brothers Harriman (Hong Kong) Limited
Level 13, Man Yee Building,
68 Des Voeux Road,
Central
Hongkong

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Informationen zur Gesellschaft

Die folgenden Informationen stammen aus dem vollständigen Text und dem Abschnitt „Definitionen“ des Verkaufsprospekts und sollten zusammen mit dem Verkaufsprospekt gelesen werden.

Natixis International Funds (Dublin) I Public Limited Company (die „Gesellschaft“) ist eine offene Umbrella-Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und Einzelhaftung ihrer Fonds. Sie wurde am 26. Juni 1997 nach irischem Recht als Public Limited Company gemäß dem Companies Act von 2014 gegründet. Die Gesellschaft wurde von der Central Bank of Ireland („Zentralbank“) gemäß der irischen Durchführungsverordnung von 2011 zu den Bestimmungen der Europäischen Gemeinschaften über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (European Communities [Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities] Regulations, 2011) in der jeweils gültigen Fassung („OGAW-Verordnungen“) als Investmentgesellschaft zugelassen. Die Gesellschaft nahm am 30. Juni 1997 ihre Geschäftstätigkeit auf.

Die PRIIPs KIIDs („PRIIPs“) des Fonds sind nach Art der Anteilsklasse gegliedert und konzentrieren sich jeweils auf einen repräsentativen Anteil einer gegebenen Anteilsklasse. Zum 31. Dezember 2023 befanden sich rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile* von sieben Fonds (die „Fonds“) im Umlauf: Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Multisector Income Fund** (im Folgenden „Loomis Sayles Multisector Income Fund“), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles High Income Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles High Income Fund“), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund“), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund“)****, Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro High Yield Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles Euro High Yield Fund“), Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Euro Credit Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles Euro Credit Fund“) and Natixis International Funds (Dublin) I - Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund*** (im Folgenden „Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund“).

Verweise in diesem Dokument auf einen Fonds stellen kein Angebot oder eine Aufforderung zur Zeichnung von Anteilen an einem solchen Fonds dar. Wir empfehlen Ihnen, sich vor dem Kauf von Anteilen ausführlich zu informieren. Zeichnungen eines Fonds können nur auf der Grundlage des aktuellen Prospekts, der PRIIPs sowie der letzten Jahres- und Zwischenberichte erfolgen. Bitte beachten Sie auch die Risikofaktoren im Prospekt.

* Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile, auf die im gesamten Bericht Bezug genommen wird, sind gemäß der Definition im Verkaufsprospekt der Gesellschaft rückzahlbare „gewinnberechtigte Anteile“.

** In Hongkong zugelassen und für die Öffentlichkeit in Hongkong erhältlich

*** Nicht in Hongkong zugelassen und nicht für die Öffentlichkeit in Hongkong erhältlich

**** Der Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund war ab dem 5. März 2024 für Zeichnungen geschlossen.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 waren in den einzelnen Fonds folgende Anteilsklassen für Zeichnungen verfügbar:

Loomis Sayles Multisector Income Fund	Loomis Sayles High Income Fund	Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*	Loomis Sayles Euro High Yield Fund	Loomis Sayles Euro Credit Fund	Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Anteilsklasse C/A (USD)	Anteilsklasse C/A (USD)	Anteilsklasse C/A (USD)	Anteilsklasse H-I/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/A (CHF)	Anteilsklasse H-I/A (CHF)	Anteilsklasse G/A (EUR)
Anteilsklasse C/D (USD)	Anteilsklasse C/D (USD)	Anteilsklasse C/D (USD)	Anteilsklasse H-Q/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/A (GBP)	Anteilsklasse H-I/A (GBP)	Anteilsklasse H-I/A (CHF)
Anteilsklasse CT/A (USD)	Anteilsklasse CT/DM (USD)	Anteilsklasse F/D (USD)	Anteilsklasse H-R/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/D (GBP)	Anteilsklasse H-I/A (USD)	Anteilsklasse H-I/A (GBP)
Anteilsklasse CT/DG (USD)	Anteilsklasse F/A (USD)	Anteilsklasse H-F/A (GBP)	Anteilsklasse H-R/D (EUR)	Anteilsklasse H-N/A (CHF)	Anteilsklasse H-I/D (GBP)	Anteilsklasse H-I/D (GBP)
Anteilsklasse CT/DM (USD)	Anteilsklasse H-I/A (CHF)	Anteilsklasse H-F/D (GBP)	Anteilsklasse H-RE/A (EUR)	Anteilsklasse H-N/A (GBP)	Anteilsklasse H-N/A (CHF)	Anteilsklasse H-N/A (CHF)
Anteilsklasse CW/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/A (AUD)	Anteilsklasse H-RE/D (EUR)	Anteilsklasse H-N/D (GBP)	Anteilsklasse H-N/A (GBP)	Anteilsklasse H-N/A (GBP)
Anteilsklasse F/A (USD)	Anteilsklasse H-I/A (SGD)	Anteilsklasse H-I/A (EUR)	Anteilsklasse I/A (GBP)	Anteilsklasse H-R/A (CHF)	Anteilsklasse H-N/A (USD)	Anteilsklasse H-N/D (GBP)
Anteilsklasse F/DM (USD)	Anteilsklasse H-I/D (EUR)	Anteilsklasse H-I/A (SEK)	Anteilsklasse I/A (USD)	Anteilsklasse H-RE/A (CHF)	Anteilsklasse H-N/D (GBP)	Anteilsklasse H-R/A (CHF)
Anteilsklasse H-CW/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/D (GBP)	Anteilsklasse H-I/A (SGD)	Anteilsklasse I/D (USD)	Anteilsklasse H-S/A (CHF)	Anteilsklasse H-R/A (CHF)	Anteilsklasse H-RE/A (CHF)
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/D (SGD)	Anteilsklasse H-I/A (USD)	Anteilsklasse N/A (EUR)	Anteilsklasse H-S/A (GBP)	Anteilsklasse H-RE/A (CHF)	Anteilsklasse H-S/A (CHF)
Anteilsklasse H-I/A (SEK)	Anteilsklasse H-N/A (CHF)	Anteilsklasse H-I/D (EUR)	Anteilsklasse N/A (USD)	Anteilsklasse H-S/D (GBP)	Anteilsklasse H-S/A (CHF)	Anteilsklasse H-S/A (GBP)
Anteilsklasse H-I/A (SGD)	Anteilsklasse H-N/A (EUR)	Anteilsklasse H-I/D (GBP)	Anteilsklasse R/A (USD)	Anteilsklasse H-S2/A (CHF)	Anteilsklasse H-S/A (GBP)	Anteilsklasse H-S/D (GBP)
Anteilsklasse H-I/D (EUR)	Anteilsklasse H-N/A (GBP)	Anteilsklasse H-I/D (SGD)	Anteilsklasse S/A (EUR)	Anteilsklasse H-S2/A (GBP)	Anteilsklasse H-S/A (USD)	Anteilsklasse H-S2/A (CHF)
Anteilsklasse H-I/D (GBP)	Anteilsklasse H-N/D (CHF)	Anteilsklasse H-N/A (CHF)	Anteilsklasse S/A (GBP)	Anteilsklasse H-S2/D (GBP)	Anteilsklasse H-S/D (GBP)	Anteilsklasse H-S2/A (GBP)
Anteilsklasse H-I/D (SEK)	Anteilsklasse H-N/D (EUR)	Anteilsklasse H-N/A (EUR)	Anteilsklasse S/A (USD)	Anteilsklasse I/A (EUR)	Anteilsklasse H-S2/A (CHF)	Anteilsklasse H-S2/D (GBP)
Anteilsklasse H-I/D (SGD)	Anteilsklasse H-N/D (GBP)	Anteilsklasse H-N/A (GBP)	Anteilsklasse S/D (USD)	Anteilsklasse I/D (EUR)	Anteilsklasse H-S2/A (GBP)	Anteilsklasse I/A (EUR)
Anteilsklasse H-N/A (CHF)	Anteilsklasse H-N/DM (GBP)	Anteilsklasse H-N/D (CHF)		Anteilsklasse N/A (EUR)	Anteilsklasse H-S2/A (USD)	Anteilsklasse I/D (EUR)
Anteilsklasse H-N/A (EUR)	Anteilsklasse H-N1/A (CHF)	Anteilsklasse H-N/D (EUR)		Anteilsklasse N/D (EUR)	Anteilsklasse H-S2/D (GBP)	Anteilsklasse N/A (EUR)
Anteilsklasse H-N/A (GBP)	Anteilsklasse H-N1/A (EUR)	Anteilsklasse H-N/D (GBP)		Anteilsklasse Q/A (EUR)	Anteilsklasse I/A (EUR)	Anteilsklasse N/D (EUR)
Anteilsklasse H-N/D (CHF)	Anteilsklasse H-R/A (EUR)	Anteilsklasse H-N/DM (GBP)		Anteilsklasse R/A (EUR)	Anteilsklasse I/D (EUR)	Anteilsklasse Q/A (EUR)
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	Anteilsklasse H-R/A (SGD)	Anteilsklasse H-R/A (EUR)		Anteilsklasse R/D (EUR)	Anteilsklasse N/A (EUR)	Anteilsklasse R/A (EUR)
Anteilsklasse H-N/D (GBP)	Anteilsklasse H-R/D (EUR)	Anteilsklasse H-R/A (SEK)		Anteilsklasse RE/A (EUR)	Anteilsklasse N/D (EUR)	Anteilsklasse R/D (EUR)
Anteilsklasse H-N/DM (GBP)	Anteilsklasse H-R/D (SGD)	Anteilsklasse H-R/A (SGD)		Anteilsklasse RE/D (EUR)	Anteilsklasse Q/A (EUR)	Anteilsklasse RE/A (EUR)
Anteilsklasse H-N1/A (EUR)	Anteilsklasse H-RE/A (EUR)	Anteilsklasse H-R/D (EUR)		Anteilsklasse S/A (EUR)	Anteilsklasse R/A (EUR)	Anteilsklasse RE/D (EUR)
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	Anteilsklasse H-RE/D (EUR)	Anteilsklasse H-R/D (SGD)		Anteilsklasse S/D (EUR)	Anteilsklasse R/D (EUR)	Anteilsklasse S/A (EUR)
Anteilsklasse H-R/A (SEK)	Anteilsklasse H-S/A (CHF)	Anteilsklasse H-RE/A (EUR)		Anteilsklasse S2/A (EUR)	Anteilsklasse RE/A (EUR)	Anteilsklasse S/D (EUR)

* Der Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund war ab dem 5. März 2024 für Zeichnungen geschlossen.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund	**Loomis Sayles High Income Fund**	**Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund**	**Loomis Sayles Euro High Yield Fund**	**Loomis Sayles Euro Credit Fund**	**Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund**
Anteilsklasse H-R/A (SGD)	Anteilsklasse H-S/A (EUR)	Anteilsklasse H-RE/D (EUR)	Anteilsklasse S2/D (EUR)	Anteilsklasse RE/D (EUR)	Anteilsklasse S2/A (EUR)
Anteilsklasse H-R/D (EUR)	Anteilsklasse H-S/A (SGD)	Anteilsklasse H-S/A (AUD)		Anteilsklasse S/A (EUR)	Anteilsklasse S2/D (EUR)
Anteilsklasse H-R/D (SEK)	Anteilsklasse H-S/D (EUR)	Anteilsklasse H-S/A (EUR)		Anteilsklasse S/D (EUR)	Anteilsklasse S3/A (EUR)
Anteilsklasse H-R/D (SGD)	Anteilsklasse H-S/D (GBP)	Anteilsklasse H-S/A (NOK)		Anteilsklasse S1/A (EUR)	Anteilsklasse S3/D (EUR)
Anteilsklasse H-R/DM (AUD)	Anteilsklasse I/A (EUR)	Anteilsklasse H-S/A (SEK)		Anteilsklasse S2/A (EUR)	
Anteilsklasse H-R/DM (SGD)	Anteilsklasse I/A (SGD)	Anteilsklasse H-S/A (SGD)		Anteilsklasse S2/D (EUR)	
Anteilsklasse H-RE/A (EUR)	Anteilsklasse I/A (USD)	Anteilsklasse H-S/A (USD)			
Anteilsklasse H-RE/D (EUR)	Anteilsklasse I/D (GBP)	Anteilsklasse H-S/D (EUR)			
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	Anteilsklasse I/D (JPY)	Anteilsklasse H-S/D (GBP)			
Anteilsklasse H-S/A (EUR)	Anteilsklasse I/D (SGD)	Anteilsklasse H-S/D (SGD)			
Anteilsklasse H-S/A (SEK)	Anteilsklasse I/D (USD)	Anteilsklasse I/A (EUR)			
Anteilsklasse H-S/A (SGD)	Anteilsklasse N/A (EUR)	Anteilsklasse I/A (SGD)			
Anteilsklasse H-S/D (EUR)	Anteilsklasse N/A (USD)	Anteilsklasse I/A (USD)			
Anteilsklasse H-S/D (GBP)	Anteilsklasse N/DM (USD)	Anteilsklasse I/D (GBP)			
Anteilsklasse H-S/D (SEK)	Anteilsklasse N1/A (USD)	Anteilsklasse I/D (SGD)			
Anteilsklasse I/A (EUR)	Anteilsklasse Q/A (USD)	Anteilsklasse I/D (USD)			
Anteilsklasse I/A (SGD)	Anteilsklasse R/A (EUR)	Anteilsklasse N/A (EUR)			
Anteilsklasse I/A (USD)	Anteilsklasse R/A (SGD)	Anteilsklasse N/A (USD)			
Anteilsklasse I/D (GBP)	Anteilsklasse R/A (USD)	Anteilsklasse N/DM (USD)			
Anteilsklasse I/D (SGD)	Anteilsklasse R/D (EUR)	Anteilsklasse N1/A (EUR)			
Anteilsklasse I/D (USD)	Anteilsklasse R/D (GBP)	Anteilsklasse N1/A (USD)			
Anteilsklasse I/DG (USD)	Anteilsklasse R/D (SGD)	Anteilsklasse R/A (EUR)			
Anteilsklasse J/DM (USD)	Anteilsklasse R/D (USD)	Anteilsklasse R/A (SGD)			
Anteilsklasse N/A (EUR)	Anteilsklasse R/DM (USD)	Anteilsklasse R/A (USD)			
Anteilsklasse N/A (USD)	Anteilsklasse RE/A (EUR)	Anteilsklasse R/D (EUR)			
Anteilsklasse N/DM (USD)	Anteilsklasse RE/A (USD)	Anteilsklasse R/D (GBP)			
Anteilsklasse N1/A (EUR)	Anteilsklasse RE/D (EUR)	Anteilsklasse R/D (SGD)			
Anteilsklasse N1/A (USD)	Anteilsklasse RE/D (USD)	Anteilsklasse R/D (USD)			
Anteilsklasse N1/D (USD)	Anteilsklasse S/A (EUR)	Anteilsklasse RE/A (EUR)			

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund	**Loomis Sayles High Income Fund**	**Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund**
Anteilsklasse R/A (EUR)	Anteilsklasse S/A (SGD)	Anteilsklasse RE/A (USD)
Anteilsklasse R/A (SGD)	Anteilsklasse S/A (USD)	Anteilsklasse RE/D (EUR)
Anteilsklasse R/A (USD)	Anteilsklasse S/D (GBP)	Anteilsklasse RE/D (USD)
Anteilsklasse R/D (EUR)	Anteilsklasse S/D (JPY)	Anteilsklasse RE/DM (USD)
Anteilsklasse R/D (GBP)	Anteilsklasse S/D (SGD)	Anteilsklasse S/A (EUR)
Anteilsklasse R/D (SGD)	Anteilsklasse S/D (USD)	Anteilsklasse S/A (SGD)
Anteilsklasse R/D (USD)		Anteilsklasse S/A (USD)
Anteilsklasse R/DG (USD)		Anteilsklasse S/D (GBP)
Anteilsklasse R/DM (USD)		Anteilsklasse S/D (SGD)
Anteilsklasse RE/A (EUR)		Anteilsklasse S/D (USD)
Anteilsklasse RE/A (USD)		
Anteilsklasse RE/D (EUR)		
Anteilsklasse RE/D (USD)		
Anteilsklasse RE/DM (USD)		
Anteilsklasse S/A (EUR)		
Anteilsklasse S/A (SGD)		
Anteilsklasse S/A (USD)		
Anteilsklasse S/D (GBP)		
Anteilsklasse S/D (SGD)		
Anteilsklasse S/D (USD)		

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Die einzelnen Anteilsklassen werden bestimmten Zielgruppen angeboten:

Zielgruppe	Angebotene Anteilsklassen
Privatanleger	Klasse C, Klasse CT, Klasse CW, Klasse F, Klasse N, Klasse N1, Klasse R und Klasse RE
Institutionelle Anleger	Klasse I, Klasse J, Klasse S, Klasse S2 und Klasse Q

Die Funktionalwährung des Loomis Sayles Multisector Income Fund, des Loomis Sayles High Income Fund, des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund ist derzeit der US-Dollar (USD).

Die Funktionalwährung des Loomis Sayles Euro High Yield Fund, des Loomis Sayles Euro Credit Fund und des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund ist derzeit der Euro (EUR).

Die Funktionalwährung des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund war bis zu seiner Schließung am 5. März 2024 der US-Dollar (USD).

Die Anteilsklassen der einzelnen Fonds lauteten zum 31. Dezember 2023 auf die folgenden Währungen:

Währung	Anteilsklasse
US-Dollar (USD)	Klasse C, Klasse CT, Klasse F, Klasse H-I, Klasse H-S, Klasse I, Klasse J, Klasse N, Klasse N1, Klasse R, Klasse RE und Klasse S
Euro (EUR)	Klasse CW, Klasse G, Klasse H-CW, Klasse H-I, Klasse H-N, Klasse H-N1, Klasse H-Q, Klasse H-R, Klasse H-RE, Klasse H-S, Klasse I, Klasse N, Klasse N1, Klasse Q, Klasse R, Klasse RE, Klasse S, Klasse S2 und Klasse S3
Pfund Sterling (GBP)	Klasse H-F, Klasse H-I, Klasse H-N, Klasse H-S, Klasse H-S2, Klasse I, Klasse R und Klasse S
Norwegische Krone (NOK)	Klasse H-S
Schwedische Krone (SEK)	Klasse H-I, Klasse H-R und Klasse H-S
Singapur-Dollar (SGD)	Klasse H-I, Klasse H-R, Klasse H-S, Klasse I, Klasse R und Klasse S
Japanischer Yen (JPY)	Klasse I und Klasse S
Schweizer Franken (CHF)	Klasse H-I, Klasse H-N, Klasse H-N1, Klasse H-R, Klasse H-RE, Klasse H-S und Klasse H-S2
Australischer Dollar (AUD)	Klasse H-I, Klasse H-R, Klasse H-RE und Klasse H-S

Zum 31. Dezember 2023 befanden sich keine Anteile der Klassen CW und J im Umlauf.

Anlageziele und -grundsätze

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Anlageziel des Loomis Sayles Multisector Income Fund (der „Fonds“) ist es, durch eine Kombination aus laufenden Erträgen und Kapitalzuwächsen eine hohe Gesamtrendite zu erzielen. Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Anleihen und ähnliche festverzinsliche Wertpapiere, die von der US-Regierung oder deren Behörden oder Institutionen oder von supranationalen Organisationen (z. B. der Weltbank) ausgegeben oder garantiert werden, sowie in Commercial Paper, Nullkuponanleihen, Asset-Backed Securities, Mortgage-Backed Securities (einschließlich Collateralised Mortgage Obligations), When-Issued Securities, Wertpapiere gemäß Regulation S und Rule 144A des US Securities Act, strukturierte Schuldverschreibungen (Structured Notes) sowie Wandelanleihen im Einklang mit den OGAW-Verordnungen.

Der Fonds darf bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in anderen als den vorstehend beschriebenen Wertpapieren investieren, darunter Stammaktien, Vorzugsaktien und geschlossene US-REITs (Real Estate Investment Trusts). Außerdem darf der Fonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen investieren. Der Fonds kann einen beliebigen Betrag seines Vermögens in Wertpapieren US-amerikanischer und kanadischer Emittenten anlegen. Diese Wertpapiere müssen weltweit an den im Verkaufsprospekt aufgeführten Märkten notiert sein oder gehandelt werden. Bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts können zudem in Wertpapiere anderer, nichtamerikanischer und nichtkanadischer Emittenten investiert werden, einschließlich Emittenten in Schwellenländern. Der Fonds kann einen beliebigen Betrag seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere supranationaler Emittenten investieren. Der Fonds darf in Wertpapiere investieren, die auf eine beliebige Währung lauten, einschließlich der Währungen von Schwellenländern. Der Fonds darf in Wertpapiere mit beliebiger Laufzeit investieren. Außerdem kann der Fonds bis zu 35 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere mit einem Rating ohne Investment Grade anlegen. Wertpapiere mit einem Rating ohne Investment Grade sind Wertpapiere, die mit einem Rating unterhalb von BBB- (Standard & Poor’s Ratings Services), Baa3 (Moody’s Investor Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – von der Verwaltungsgesellschaft oder einen Anlageverwalter als gleichwertig eingestuft werden. Für den Anteil des Fondsvermögens, der in Barmittel oder Geldmarktinstrumente investiert wird, bestehen keine Beschränkungen.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Loomis Sayles High Income Fund

Anlageziel des Loomis Sayles High Income Fund (der „Fonds“) ist es, durch eine Kombination aus laufenden Erträgen und Kapitalzuwächsen eine hohe Gesamtrendite zu erzielen. Mindestens 51 % des Nettoinventarwerts des Fonds werden in festverzinsliche Wertpapiere investiert, die weltweit an den im Verkaufsprospekt aufgeführten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Die festverzinslichen Wertpapiere, in die der Fonds investieren darf, umfassen Unternehmensanleihen, Wertpapiere, die von der US-Regierung, deren Behörden oder Institutionen begeben oder garantiert werden („US-Staatsanleihen“), von supranationalen Organisationen (z. B. der Weltbank) ausgegebene oder garantierte Wertpapiere, Commercial Paper, Nullkuponanleihen, Mortgage-Backed Securities, Collateralised Mortgage Obligations, Asset-Backed Securities, US-REITs (Real Estate Investment Trusts), Wertpapiere gemäß Regulation S und Rule 144A des US Securities Act sowie wandelbare Wertpapiere gemäß den OGAW-Verordnungen.

Der Fonds kann bis zu 49 % seines Nettoinventarwerts in Barmitteln oder anderen als den vorstehend beschriebenen Wertpapieren anlegen. Der Fonds legt maximal 20 % seines Nettoinventarwerts in Vorzugsaktien und bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Stammaktien an. Darüber hinaus legt der Teilfonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteilen an Organismen für gemeinsame Anlagen an. Der Teilfonds kann ferner einen beliebigen Anteil seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere US-amerikanischer, kanadischer und supranationaler Emittenten und bis zu 50 % seines Nettoinventarwerts in Titel nicht US-amerikanischer, nicht kanadischer und nicht supranationaler Emittenten investieren. Ein beliebiger Teil des Fondsvermögens kann in Wertpapieren ohne Investment Grade-Rating angelegt werden.

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Anlageziel des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (der „Fonds“) ist es, durch eine Kombination aus hohen laufenden Erträgen und Kapitalzuwächsen eine hohe Gesamtrendite zu erzielen. Der Fonds investiert vornehmlich in festverzinsliche Wertpapiere internationaler Emittenten. Die Titel werden gelegenheitsbedingt ausgewählt. Mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts werden in festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating investiert, die von Emittenten aus aller Welt ausgegeben werden. Diese Wertpapiere müssen weltweit an den im Verkaufsprospekt aufgeführten Märkten sowie zum Zwecke der Absicherung und eines effizienten Portfoliomanagements in globalen Währungen, unter Berücksichtigung von Fremdwährungsgeschäften, notiert sein oder gehandelt werden. Die festverzinslichen Wertpapiere, in die der Fonds investieren darf, umfassen festverzinsliche Unternehmensanleihen, festverzinsliche Wertpapiere, die von Staaten oder internationalen Organisationen öffentlich-rechtlichen Charakters herausgegeben oder garantiert werden, sowie Nullkuponanleihen, Wertpapiere gemäß Regulation S und gemäß Rule 144A, Asset-Backed- bzw. Mortgage-Backed Securities. Festverzinsliche Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating sind Wertpapiere, die mindestens mit einem Rating von BBB- (Standard & Poor’s Ratings Services), Baa3 (Moody’s Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden.

Der Fonds darf in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die in einer beliebigen Währung denominiert sind und durch beliebige Emittenten in Ländern begeben werden, deren Wertpapiermärkte im Aufbau begriffen sind. Der Fonds darf in festverzinsliche Wertpapiere jeder Fälligkeit investieren. Der Teilfonds darf in Währungen investieren, die nicht seine Basiswährung sind.

Bis zu ein Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds kann in Barmittel oder andere als die zuvor beschriebenen Wertpapiere investiert werden. Dazu zählen Hybrid-Anleihen, Commercial Paper, Collateralised Mortgage Obligations, wandelbare Wertpapiere, Aktien und andere aktienähnliche Wertpapiere gemäß den OGAW-Verordnungen. Außerdem können bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Wertpapieren mit einem Rating unter „Investment Grade“ angelegt werden (die allgemein als „Ramschanleihen“ bezeichnet werden). Außerdem darf der Fonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen investieren. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Gesamtvermögens in festverzinsliche Wertpapiere investieren, die am China Interbank Bond Market notiert sind, und zwar durch den gegenseitigen Zugang zum Anleihenmarkt zwischen Festlandchina und Hongkong („Bond Connect“). Maximal 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Wandelanleihen investiert werden und bis zu 10 % in Aktien und andere aktienähnliche Wertpapiere wie Stammaktien, Warrants und Depositary Receipts sämtlicher genannten Aktienanlagen.

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (zum 5. März 2024 für Zeichnungen geschlossen)

Das Anlageziel des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (der „Fonds“) besteht darin, positive absolute Renditen und Kapitalwachstum zu erreichen. Der Fonds wird versuchen, dieses Anlageziel zu erreichen, indem er versucht, über eine breite Palette von Anlageklassen hinweg Risikoprämien zu vereinnahmen, die mit einer Reihe von Investmentfaktoren verbunden sind.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Der Fonds wird bestrebt sein, global in das ganze Spektrum der zulässigen Anlagen zu investieren, d. h. Schuldtitel, Eigenkapitaltitel, Aktien oder Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich ETFs), Derivate, Barmittel oder liquiditätsähnliche Instrumente. Der Fonds kann in erheblichem Umfang Derivate einsetzen. Der Fonds kann ferner durch geeignete Exchange Traded Notes (ETNs), die die Anforderungen an übertragbare Wertpapiere im Sinne von Regulation 3(1) der Regulations erfüllen, in Rohstoffe sowie durch Total Return Swaps (TRS) in Rohstoffindizes investieren.

Die Schuldtitel, in die der Fonds investieren kann, umfassen öffentliche Schuldverschreibungen (zum Beispiel Staatsanleihen) und private Schuldverschreibungen (zum Beispiel Unternehmensanleihen). Diese werden von Emittenten überall auf der Welt begeben oder garantiert, insbesondere von bzw. durch Unternehmen, Staaten (einschließlich ihrer Behörden, Institutionen und quasi-staatlichen Organisationen) sowie supranationale Einrichtungen (z. B. die Weltbank). Der Fonds kann in variabel verzinsliche Wertpapiere, Commercial Paper, Wertpapiere gemäß Regulation S und Rule 144A des US Securities Act sowie wandelbare Wertpapiere investieren, die von Unternehmen emittiert wurden.

Ein beliebiger Teil des Nettoinventarwerts des Fonds kann in Wertpapieren angelegt werden, die ein Investment-Grade-Rating oder ein niedrigeres Rating besitzen. Investment-Grade-Wertpapiere sind Wertpapiere, die mit einem Rating besser als BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden. Wertpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment-Grade sind Wertpapiere, die mit einem Rating unterhalb von BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden.

Der Fonds kann in folgende Eigenkapitaltitel investieren: Stammaktien, Vorzugsaktien, ergänzend auch aktienbezogene Anlageinstrumente wie Optionsscheine, aktiengebundene Schuldverschreibungen, deren Wert sich aus dem Wert jener Eigenkapitaltitel ableitet, an die sie gebunden sind, sowie Depositary Receipts sämtlicher genannter Eigenkapitalanlagen.

Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts können in Organismen für gemeinsame Anlagen (unter anderem auch börsengehandelte Fonds, die als OGAW zugelassen sind) investiert werden.

Zu Anlagezwecken und zur effizienten Portfolioverwaltung kann der Fonds:

- Futures-Kontrakte und Optionen auf Finanzindizes, Aktien, Schuldtitel und Zinssätze eingehen, um ein globales Engagement über das gesamte Spektrum zulässiger Vermögenswerte einschließlich Eigenkapitaltitel und Schuldtitel zu erzielen;
- Futures-Kontrakte und Optionen auf Währungen und Devisentermingeschäfte eingehen, die dem Fonds ein Engagement in verschiedenen Währungen ermöglichen, und
- TRS auf Finanzindizes abschließen, um Engagements in Rohstoffen oder Vermögenswerten einzugehen, bei denen ein Engagement über traditionelle Anlagen in physische Wertpapiere teuer oder ineffizient wäre;
- im Markt für Kreditderivate durch den Abschluss von Credit Default Swaps aktiv werden und sich in kreditbasierten Indizes durch Futures und Optionen engagieren, um Absicherungspositionen zu kaufen oder zu verkaufen;
- Zinsswaps eingehen, um durch den Austausch von festen Zinszahlungen (in einem Bullenmarkt) gegen variable Zinszahlungen (in einem Bärenmarkt) oder umgekehrt (je nach Markttrend) Zinsprämien an den globalen Märkten zu realisieren, und
- in ETNs investieren, um ein indirektes Engagement in Rohstoffe zu erzielen.

Zur Unterstützung der Nutzung von Derivaten durch den Fonds kann der Fonds in Geldmarktinstrumente und kurzfristige Schuldtitel investieren oder Barmittel halten. Geldmarktinstrumente, kurzfristige Schuldtitel, Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente können unter anderem Einlagenzertifikate, Commercial Paper, US-Treasury Bills, Schuldtitel von Unternehmen (z. B. Unternehmensanleihen) und kurzfristige Anleihen, die von staatlichen Emittenten, internationalen Einrichtungen öffentlich-rechtlichen Charakters oder sonstigen öffentlichen Emittenten ausgegeben oder garantiert werden, und Termineinlagen umfassen.

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Zusätzlich zum Eingehen von Long-Positionen in Bezug auf die vorgenannten Anlageklassen kann der Fonds auch in allen Anlageklassen synthetische Short-Positionen durch Derivate eingehen. Es ist dem Fonds nicht gestattet, „physische Leerverkäufe“ zu tätigen. Der Fonds wird im Allgemeinen im Rahmen eines Portfolios bis zu 250 % seines Nettoinventarwertes in Long-Positionen und bis zu 250 % seines Nettoinventarwertes in Short-Positionen investieren. Der Portfolioverwalter kann Long- und Short-Positionen eingehen, um positive Renditen zu erwirtschaften. Short-Positionen können jedoch auch eingesetzt werden, um bestimmte Risikopositionen im Portfolio abzusichern (z. B. Währungs- oder Zinsrisiken).

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Anlageziel des Loomis Sayles Euro High Yield Fund (der „Fonds“) ist es, durch eine Kombination aus Erträgen und Kapitalzuwächsen eine Rendite zu erwirtschaften.

Der Fonds kann einen beliebigen Teil seines Nettoinventarwerts in auf Euro lautende Schuldtitel von Unternehmen (z. B. Unternehmensanleihen) mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investieren. Die Schuldtitel, in die der Fonds investiert, können von Unternehmen überall auf der Welt begeben werden, die auch an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Wertpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade sind Wertpapiere, die mit einem Rating unterhalb von BBB- (Standard & Poor’s Ratings Services), Baa3 (Moody’s Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden. Höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in hochspekulative Schuldtitel mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investiert werden, die mit einem Rating von B+, B oder B- (Standard & Poor's Ratings Services), B1, B2 oder B3 (Moody's Investors Service, Inc.) oder einem gleichwertigen Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als gleichwertig eingestuft werden. Der Fonds kann bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating investieren, wobei es sich um Wertpapiere mit einem Rating größer oder gleich BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings handelt oder um Wertpapiere, die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden. Im Fall einer Emission mit unterschiedlichen Ratings wird das jeweils durchschnittliche Rating berücksichtigt.

Der Fonds darf nicht mehr als 20 % seines Nettoinventarwerts in staatliche Schuldtitel (z. B. Staatsanleihen) mit Investment-Grade-Rating und/oder mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investieren. Diese werden von Emittenten überall auf der Welt begeben oder garantiert, insbesondere von bzw. durch Staaten (einschließlich ihrer Behörden, Institutionen und quasi-staatlichen Organisationen) sowie supranationale Einrichtungen (z. B. die Weltbank). Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts zum Zeitpunkt des Erwerbs in Schuldtitel investieren, die auf andere Währungen als Euro lauten.

Der Fonds darf nicht in forderungsbesicherte Wertpapiere investieren und wird nicht in Aktienwerte investieren. Außerdem darf der Fonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen investieren.

Der Fonds darf nicht in Schuldtitel investieren, die mit einem Rating von CCC+ (Standard & Poor’s Ratings Services), Caa1 (Moody’s Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings oder darunter ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als gleichwertig eingestuft werden. Wenn die Kreditratings von Schuldtiteln unter B- (Standard & Poor’s Ratings Services), B3 (Moody’s Investors Services, Inc.) oder ein entsprechendes Rating von Fitch Ratings herabgestuft werden, kann der Fonds die betroffenen Schuldtitel weiter halten. Vorbehaltlich der Marktlage zum relevanten Zeitpunkt und sofern es im besten Interesse der Anleger ist, wird das betroffene Wertpapier innerhalb von sechs Monaten nach der Herabstufung verkauft, es sei denn, eine nachfolgende Heraufstufung innerhalb desselben Zeitraums erhöht das Kreditrating wieder auf ein Niveau, durch mit dem die maßgebliche Grenze, wie oben dargelegt, eingehalten wird.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann der Fonds:

- Futures, Swaps, Devisenoptionen und Termingeschäfte (Forwards) verwenden, um seine Vermögenswerte in zins-, wechselkurs- oder kreditbezogenen Risiken zu engagieren oder diese dagegen abzusichern, unter Einhaltung der in Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage“ beschriebenen Grenzen;
- Zinsswaps eingehen, um durch den Austausch von festen Zinszahlungen (in einem Bullenmarkt) gegen variable Zinszahlungen (in einem Bärenmarkt) oder umgekehrt (je nach Markttrend) Zinsprämien an den globalen Märkten zu realisieren;
- auf den Kreditderivatemarkt zugreifen, indem er u. a. Credit Default Swaps abschließt, um Schutz anzubieten oder in Anspruch zu nehmen. Der Fonds kann Kreditderivate einsetzen, um die spezifischen Kreditrisiken bestimmter Emittenten in seinem Portfolio abzusichern, indem er Schutz kauft. Außerdem kann der Fonds, wenn dies in seinem besten Interesse liegt, mithilfe von Kreditderivaten Schutz kaufen, ohne die zugrunde liegenden Vermögenswerte zu halten. Sofern dies in seinem besten Interesse liegt, kann der Fonds auch mithilfe von Kreditderivaten Schutz verkaufen, um ein bestimmtes Kreditengagement zu erwerben; und
- ergänzend in Finanzderivate investieren, die mit einem oder mehreren Kreditindizes verbunden sind, wie z. B. dem Markit iTraxx® Europe Main Index und dem Markit iTraxx® Crossover Index. Informationen zu diesen Indizes sind auf der Markit-Website (www.markit.com) erhältlich. Die Bestandteile dieser Indizes werden im Allgemeinen halbjährlich neu gewichtet. Es wird erwartet, dass die mit der Neugewichtung dieser Indizes verbundenen Kosten normalerweise vernachlässigbar sind.

Zur Unterstützung der Nutzung von Derivaten durch den Fonds kann der Fonds in Geldmarktinstrumente und kurzfristige Schuldtitel investieren oder Barmittel halten. Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung dürfen derivative Instrumente eingesetzt werden, vorbehaltlich der Einhaltung der Bedingungen und Begrenzungen gemäß Anhang II des Prospekts. Einzelheiten dazu entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Verwendung von Finanzderivaten“ des Prospekts. Der Fonds darf eine Hebelung („Leverage“) von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts aufweisen; Grundlage hierfür bildet die Verwendung des „Commitment Approach“.

Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der höchstens bei TRS zum Einsatz kommen kann, liegt bei 100 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei TRS voraussichtlich zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der höchstens bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften zum Einsatz kommen kann, liegt bei 100 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften voraussichtlich zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Weitere Informationen zu Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften finden Sie im Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage“.

Werden die zuvor erwähnten Anlagegrenzen aus Gründen, auf die der Fonds keinen Einfluss hat, oder infolge der Ausübung von Zeichnungsrechten überschritten, hat der Fonds bei seinen Verkaufstransaktionen vordringlich dafür zu sorgen, dass dieses Problem behoben wird, wobei die Interessen der Anteilinhaber zu wahren sind.

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Anlageziel des Loomis Sayles Euro Credit Fund (der „Fonds“) ist es, durch eine Kombination aus Erträgen und Kapitalzuwächsen eine Rendite zu erwirtschaften.

Der Fonds kann einen beliebigen Teil seines Nettoinventarwerts in auf Euro lautende Schuldtitel von Unternehmen (z. B. Unternehmensanleihen) mit Investment-Grade-Rating investieren. Die Schuldtitel, in die der Fonds investiert, können von Unternehmen überall auf der Welt begeben werden, die auch an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating sind Wertpapiere, die mit einem Rating größer oder gleich BBB- (Standard & Poor’s Ratings Services), Baa3 (Moody’s Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden. Im Fall einer Emission mit unterschiedlichen Ratings wird das jeweils niedrigere Rating berücksichtigt. Der Fonds kann zudem einen beliebigen Teil seines Nettoinventarwerts in staatliche Schuldtitel (z. B. Staatsanleihen) mit Investment-Grade-Rating investieren, die von Staaten (einschließlich ihrer Behörden, Institutionen und quasi-staatlichen Organisationen) sowie supranationalen Einrichtungen (z. B. der Weltbank) begeben werden.

Der Fonds kann bis zu 10 % seines Vermögens in Wertpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investieren. Allerdings müssen solche Wertpapiere zum Zeitpunkt des Erwerbs über ein Rating von mindestens BB- (Standard & Poor’s Ratings Services), Ba3 (Moody’s Investors Services, Inc.) oder ein entsprechendes Rating von Fitch Ratings verfügen. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts zum Zeitpunkt des Erwerbs in Schuldtitel investieren, die auf andere Währungen als Euro lauten.

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Der Fonds darf nicht in forderungsbesicherte Wertpapiere investieren und wird nicht in Aktienwerte investieren. Außerdem darf der Fonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen investieren.

Der Fonds darf nicht in Schuldtitel mit einem Rating von B+ (Standard & Poor's Ratings Services), B1 (Moody's Investors Services, Inc.) oder einem vergleichbaren Rating von Fitch Ratings oder einem darunter liegenden Rating investieren. Wenn die Kreditratings von Schuldtiteln unter BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.) oder ein entsprechendes Rating von Fitch Ratings herabgestuft werden, kann der Fonds die betroffenen Schuldtitel weiter halten. Vorbehaltlich der Marktlage zum relevanten Zeitpunkt und sofern es im besten Interesse der Anleger ist, wird das betroffene Wertpapier innerhalb von sechs Monaten nach der Herabstufung verkauft, es sei denn, eine nachfolgende Heraufstufung innerhalb desselben Zeitraums erhöht das Kreditrating wieder auf ein Niveau, durch mit dem die maßgebliche Grenze, wie oben dargelegt, eingehalten wird.

Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann der Fonds:

- Futures, Swaps, Devisenoptionen und Termingeschäfte (Forwards) verwenden, um seine Vermögenswerte in zins-, wechselkurs- oder kreditbezogenen Risiken zu engagieren oder diese dagegen abzusichern, unter Einhaltung der in Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage" beschriebenen Grenzen;
- Zinsswaps eingehen, um durch den Austausch von festen Zinszahlungen (in einem Bullenmarkt) gegen variable Zinszahlungen (in einem Bärenmarkt) oder umgekehrt (je nach Markttrend) Zinsprämien an den globalen Märkten zu realisieren;
- auf den Kreditderivatemarkt zugreifen, indem er u. a. Credit Default Swaps abschließt, um Schutz anzubieten oder in Anspruch zu nehmen. Der Fonds kann Kreditderivate einsetzen, um die spezifischen Kreditrisiken bestimmter Emittenten in seinem Portfolio abzusichern, indem er Schutz kauft. Außerdem kann der Fonds, wenn dies in seinem besten Interesse liegt, mithilfe von Kreditderivaten Schutz kaufen, ohne die zugrunde liegenden Vermögenswerte zu halten. Sofern dies in seinem besten Interesse liegt, kann der Fonds auch mithilfe von Kreditderivaten Schutz verkaufen, um ein bestimmtes Kreditengagement zu erwerben; und
- ergänzend in Finanzderivate investieren, die mit einem oder mehreren Kreditindizes verbunden sind, wie z. B. dem Markit iTraxx® Europe Main Index und dem Markit iTraxx® Crossover Index. Informationen zu diesen Indizes sind auf der Markit-Website (www.markit.com) erhältlich. Die Bestandteile dieser Indizes werden im Allgemeinen halbjährlich neu gewichtet. Es wird erwartet, dass die mit der Neugewichtung dieser Indizes verbundenen Kosten normalerweise vernachlässigbar sind.

Zur Unterstützung der Nutzung von Derivaten durch den Fonds kann der Fonds in Geldmarktinstrumente und kurzfristige Schuldtitel investieren oder Barmittel halten. Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung dürfen derivative Instrumente eingesetzt werden, vorbehaltlich der Einhaltung der Bedingungen und Begrenzungen gemäß Anhang II des Prospekts. Einzelheiten dazu entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Verwendung von Finanzderivaten" des Prospekts. Der Fonds darf eine Hebelung („Leverage") von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts aufweisen; Grundlage hierfür bildet die Verwendung des „Commitment Approach".

Der maximale Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei TRS zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der höchstens bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften zum Einsatz kommen kann, liegt bei 100 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften voraussichtlich zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Weitere Informationen zu Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften finden Sie im Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage".

Werden die zuvor erwähnten Anlagegrenzen aus Gründen, auf die der Fonds keinen Einfluss hat, oder infolge der Ausübung von Zeichnungsrechten überschritten, hat der Fonds bei seinen Verkaufstransaktionen vordringlich dafür zu sorgen, dass dieses Problem behoben wird, wobei die Interessen der Anteilinhaber zu wahren sind.

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Das Anlageziel des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (der „Fonds") besteht darin, durch einen Anlageprozess, der ESG-Überlegungen (Umwelt, Soziales und Governance) berücksichtigt, eine Rendite in Form von Kapitalzuwachs und Erträgen zu erzielen.

Der Fonds kann einen beliebigen Teil seines Nettoinventarwerts in auf Euro lautende Schuldtitel von Unternehmen (z. B. Unternehmensanleihen) mit Investment-Grade-Rating investieren. Die Schuldtitel, in die der Fonds investiert, können von Unternehmen überall auf der Welt begeben werden, die auch an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Bei den Schuldtiteln, in die der Fonds investiert, kann es sich vorbehaltlich der oben beschriebenen Hauptanlagestrategie und der in diesen Anlagegrundsätzen enthaltenen Spezifikationen auch um Green Bonds handeln. Wertpapiere mit Investment-Grade-Rating sind Wertpapiere, die mit einem Rating größer oder gleich BBB- (Standard & Poor's Ratings Services), Baa3 (Moody's Investors Service, Inc.) oder einem entsprechenden Rating von Fitch Ratings ausgestattet sind, oder die – sofern sie über kein Rating verfügen – vom Portfolioverwalter als qualitativ gleichwertig eingestuft wurden. Im Fall einer Emission mit unterschiedlichen Ratings wird das jeweils niedrigere Rating berücksichtigt. Der Fonds kann zudem einen beliebigen Teil seines Nettoinventarwerts in staatliche Schuldtitel (z. B. Staatsanleihen) mit Investment-Grade-Rating investieren, die von Staaten (einschließlich ihrer Behörden, Institutionen und quasi-staatlichen Organisationen) sowie supranationalen Einrichtungen (z. B. der Weltbank) begeben werden.

Der Fonds kann bis zu 10 % seines Vermögens in Wertpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade investieren. Allerdings müssen solche Wertpapiere zum Zeitpunkt des Erwerbs über ein Rating von mindestens BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.) oder ein entsprechendes Rating von Fitch Ratings verfügen. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts zum Zeitpunkt des Erwerbs in Schuldtitel investieren, die auf andere Währungen als Euro lauten.

Der Fonds darf nicht in forderungsbesicherte Wertpapiere investieren und wird nicht in Aktienwerte investieren. Außerdem darf der Fonds bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen investieren.

Der Fonds darf nicht in Schuldtitel mit einem Rating von B+ (Standard & Poor's Ratings Services), B1 (Moody's Investors Services, Inc.) oder einem vergleichbaren Rating von Fitch Ratings oder einem darunter liegenden Rating investieren. Wenn die Kreditratings von Schuldtiteln unter BB- (Standard & Poor's Ratings Services), Ba3 (Moody's Investors Services, Inc.) oder ein entsprechendes Rating von Fitch Ratings herabgestuft werden, kann der Fonds die betroffenen Schuldtitel weiter halten. Vorbehaltlich der Marktlage zum relevanten Zeitpunkt und sofern es im besten Interesse der Anleger ist, wird das betroffene Wertpapier innerhalb von sechs Monaten nach der Herabstufung verkauft, es sei denn, eine nachfolgende Heraufstufung innerhalb desselben Zeitraums erhöht das Kreditrating wieder auf ein Niveau, durch mit dem die maßgebliche Grenze, wie oben dargelegt, eingehalten wird.

Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann der Fonds:

- Futures, Swaps, Devisenoptionen und Termingeschäfte (Forwards) verwenden, um seine Vermögenswerte in zins-, wechselkurs- oder kreditbezogenen Risiken zu engagieren oder diese dagegen abzusichern, unter Einhaltung der in Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage" beschriebenen Grenzen;
- Zinsswaps eingehen, um durch den Austausch von festen Zinszahlungen (in einem Bullenmarkt) gegen variable Zinszahlungen (in einem Bärenmarkt) oder umgekehrt (je nach Markttrend) Zinsprämien an den globalen Märkten zu realisieren;
- auf den Kreditderivatemarkt zugreifen, indem er Credit Default Swaps abschließt, um Schutz anzubieten oder in Anspruch zu nehmen. Der Fonds kann Credit Default Swaps einsetzen, um die spezifischen Kreditrisiken bestimmter Emittenten in seinem Portfolio abzusichern, indem er Schutz kauft. Außerdem kann der Fonds, wenn dies in seinem besten Interesse liegt, mithilfe von Credit Default Swaps Schutz kaufen, ohne die zugrunde liegenden Vermögenswerte zu halten. Sofern dies in seinem besten Interesse liegt, kann der Fonds auch mithilfe von Credit Default Swaps Schutz verkaufen, um ein bestimmtes Kreditengagement zu erwerben, und
- ergänzend in Finanzderivate investieren, die mit einem oder mehreren Kreditindizes verbunden sind, wie z. B. dem Markit iTraxx® Europe Main Index und dem Markit iTraxx® Crossover Index. Informationen zu diesen Indizes sind auf der Markit-Website (www.markit.com) erhältlich. Die Bestandteile dieser Indizes werden im Allgemeinen halbjährlich neu gewichtet. Es wird erwartet, dass die mit der Neugewichtung dieser Indizes verbundenen Kosten normalerweise vernachlässigbar sind.

Zur Unterstützung der Nutzung von Derivaten durch den Fonds kann der Fonds in Geldmarktinstrumente und kurzfristige Schuldtitel investieren oder Barmittel halten. Zu Anlagezwecken und zum Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung dürfen derivative Instrumente eingesetzt werden, vorbehaltlich der Einhaltung der Bedingungen und Begrenzungen gemäß Anhang II des Prospekts. Einzelheiten dazu entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Verwendung von Finanzderivaten" des Prospekts. Der Fonds darf eine Hebelung („Leverage") von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts aufweisen; Grundlage hierfür bildet die Verwendung des „Commitment Approach".

Informationen zur Gesellschaft (Fortsetzung)

Anlageziele und -politik (Fortsetzung)

Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der höchstens bei TRS zum Einsatz kommen kann, liegt bei 100 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei TRS voraussichtlich zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der höchstens bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften zum Einsatz kommen kann, liegt bei 100 %. Der Anteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften voraussichtlich zum Einsatz kommen wird, liegt bei 0 %. Weitere Informationen zu Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften finden Sie im Anhang II des Prospekts im Abschnitt „Investitionen in Finanzderivate – Effizientes Portfoliomanagement/Direktanlage".

Werden die zuvor erwähnten Anlagegrenzen aus Gründen, auf die der Fonds keinen Einfluss hat, oder infolge der Ausübung von Zeichnungsrechten überschritten, hat der Fonds bei seinen Verkaufstransaktionen vordringlich dafür zu sorgen, dass dieses Problem behoben wird, wobei die Interessen der Anteilinhaber zu wahren sind.

Effizientes Portfoliomanagement

In allen Fonds können Finanzderivate für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden. Der Loomis Sayles Multisector Income Fund darf zu diesem Zweck auch in Pensionsgeschäfte investieren.

Sonstige relevante Informationen

Die geprüften Jahresberichte und die ungeprüften Halbjahresberichte können bei Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsstelle") unter der auf Seite 4 unter „Organisation" angegebenen Adresse angefordert werden. Sie werden den Anteilinhabern auf Anfrage an deren eingetragene Anschrift zugestellt. Auch die aktuelle Fassung des Verkaufsprospekts ist bei der Verwaltungsstelle unter der auf Seite 4 genannten Anschrift erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Multisector Income Fund (Anteilsklasse I/D (USD))*	**7,74 %**
Bloomberg Barclays U.S. Government/Credit Bond Index (Total Return)	**5,72 %**

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der des Bloomberg Barclays U.S. Government/Credit Bond Index (Total Return) (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 besser als sein Referenzindex.

- Der Fonds übertraf seinen Referenzindex aufgrund der positiven Titelauswahl und Allokation.
- Die Titelauswahl in Unternehmensanleihen mit Investment Grade leistete einen positiven Beitrag, insbesondere in den Sektoren Energie, Banken und Kommunikation.
- Hochzinsanleihen trugen besonders zu Überzeugungspositionen in den Sektoren zyklische Konsumgüter und Kommunikation.
- Die Untergewichtung von US-Staatsanleihen war zuträglich.
- Die Schwellenmärkte belasteten das Ergebnis, insbesondere beim chinesischen Immobiliensektor.
- Eine Allokation in Wandelanleihen wirkte sich negativ aus, insbesondere auf die Sektoren Kommunikation und Transport.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles High Income Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles High Income Fund – Anteilsklasse I/D (USD)*	**10,81 %**
Bloomberg Barclays U.S. Corporate High-Yield Bond Index (Total Return)	**13,45** %

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der des Bloomberg Barclays U.S. Corporate High-Yield Bond Index (Total Return) (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 schlechter als sein Referenzindex.

- Der Fonds entwickelte sich schlechter als sein Referenzindex, hauptsächlich aufgrund der Titelauswahl.
- Wandelanleihen schmälerten das Ergebnis, insbesondere im Sektor Kommunikation.
- Unternehmensanleihen aus Schwellenmärkten, insbesondere asiatische, waren aufgrund der Titelauswahl abträglich.
- Barmittel und US-Staatsanleihen wirkten sich negativ aus, da die Risikobereitschaft anhielt.
- Das Engagement in Hochzinsanleihen sorgte für eine Outperformance des Fonds, insbesondere einige Hochüberzeugungspositionen in den Sektoren zyklische Konsumgüter, Kommunikation und Energie.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund – Anteilsklasse I/D (USD)*	**5,73 %**
Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (Total Return)	**5,72** %

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der des Barclays Global Aggregate Index (Total Return) (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 analog zu seinem Referenzindex.

- Der Fonds entwickelte sich parallel zu seinem Referenzindex.
- Die Renditekurve und die Durationspositionierung, eine Übergewichtung des Unternehmenssektors und der Schwellenmarktanleihen in Lokalwährung trugen zur relativen Performance bei.
- Globale Staatsanleihen und Währungsallokationen wirkten sich negativ aus.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund [(1)]

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Anteilsklasse I/A (USD))*	**12,44 %**
Kein Referenzindex	

- Alle Portfolio-Entscheidungen werden systematisch umgesetzt, basierend auf den aktuellen Bedingungen und der Art und Weise, wie das Modell diese Daten für die am besten geeignete Allokation optimiert.
- Der Fonds verzeichnete im Jahr 2023 positive absolute Renditen, insbesondere im 2. Quartal und 4. Quartal 2023.
- Aktien leisteten den größten Beitrag, insbesondere die Aktienvolatilitätskurve und die Aktienstrategien für Small-Cap-Titel aus Schwellenländern.
- Zinsen und Unternehmensanleihen wirkten sich aufgrund der Dynamik der Schwellenmärkte bei Zinssätzen und der Neuemissionsprämie für Kreditstrategien positiv aus.
- Die Währungen belasteten das Ergebnis leicht.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

[(1)] Der Fonds wurde zum 5. März 2024 für Zeichnungen geschlossen.

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Euro High Yield Fund (Anteilsklasse I/A (EUR))*	**11,42 %**
85 % ICE BofA BB Euro High Yield Non-Financial Constrained Index (Total Return), 15 % ICE BofA Euro Subordinated Financial Index (Total Return)	**10,48** %

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der eines Index aus 85 % ICE BofA BB Euro High Yield Non-Financial Constrained Index und 15 % ICE BofA Euro Subordinated Financial Index (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 besser als sein Referenzindex.

- Der Fonds übertraf seinen Referenzindex aufgrund der Titelauswahl und des Allokationseffekts.
- Titel aus den Sektoren Banken, Industriegüter und Dienstleistungen, Reisen und Freizeit, Kfz-Teile und -Ausrüstung sowie Versicherungen trugen am meisten zur positiven Wertentwicklung bei. Die größten Verlustbringer waren Titel aus den Sektoren Versorgungsunternehmen, Einzelhandel, Haushaltsartikel und Pflegeprodukte, Technologie sowie Erdöl und Erdgas.
- Deutsche Lufthansa AG, Abertis Infraestructuras SA, Citycon Oyj, Warner Music Group Corp und Castellum AB waren die größten Beitragsleister auf Emittentenebene. Die größten Verlustbringer waren Pemex Project Funding Master Trust (aus dem Portfolio ausgeschlossen), British American Tobacco PLC (ausgeschlossen), EP Infrastructure AS (ausgeschlossen), Veolia Environnement SA (ausgeschlossen) und CECONOMY AG.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Euro Credit Fund (Anteilsklasse I/A (EUR))*	**8,85 %**
iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)	**8,19** %

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der des iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return) (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 besser als sein Referenzindex.

- Der Fonds übertraf seinen Referenzindex aufgrund der Titelauswahl und des Allokationseffekts.
- Titel aus den Sektoren Banken, Industriegüter und Dienstleistungen, Immobilien, Finanzen und Versorgungsunternehmen leisteten die größten Beiträge. Die größten Verlustbringer waren Erdöl und Erdgas (aus dem Portfolio ausgeschlossen), Haushaltsartikel und Pflegeprodukte, Grundrohstoffe und Staatsanleihen.
- Credit Suisse AG, ABN AMRO Bank NV, Banque Federative du Credit Mutuel SA, Standard Chartered PLC und Deutsche Bank AG waren die größten Beitragsleister auf Emittentenebene. Die größten Verlustbringer waren BPCE Group, UniCredit SpA, EnBW Energie Baden-Württemberg AG (ausgeschlossen), Veolia Environnement SA (ausgeschlossen) und Unibail-Rodamco-Westfield SE.

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Portfolioverwalters (Fortsetzung)

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Performance über 1 Jahr	
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (Anteilsklasse I/A (EUR))*	**8,76 %**
iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return)	**8,19** %

Zur Veranschaulichung wird die Wertentwicklung des Fonds mit der des iBoxx Euro Corporates Overall Index (Total Return) (der „Referenzindex“) verglichen. Der Fonds entwickelte sich in den 12 Monaten bis zum 31. Dezember 2023 besser als sein Referenzindex.

- Der Fonds übertraf seinen Referenzindex aufgrund der Titelauswahl und des Allokationseffekts.
- Titel aus den Sektoren Banken, Industriegüter und Dienstleistungen, Immobilien, Finanzen und Versorgungsunternehmen leisteten die größten Beiträge. Die größten Verlustbringer waren Titel aus den Sektoren Erdöl und Erdgas (von der Beteiligung ausgeschlossen), Haushaltsartikel und Pflegeprodukte, Grundstoffe, Staatsanleihen und Einzelhandel.
- Credit Suisse AG, ABN AMRO Bank NV, Banque Federative du Credit Mutuel SA, Standard Chartered PLC und Deutsche Bank AG waren die größten Beitragsleister auf Emittentenebene. Die größten Verlustbringer waren Volkswagen AG (aus dem Portfolio ausgeschlossen), Enel SpA (ausgeschlossen), BPCE SA, TotalEnergie SE (ausgeschlossen) und Eni SpA (ausgeschlossen).

* Die angegebene Performance gibt die Wertentwicklung in der Vergangenheit wieder und ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die aktuelle Performance kann besser oder schlechter ausfallen als die angegebene Performance. Der angelegte Kapitalbetrag und die Erträge schwanken im Zeitverlauf (unter anderem aufgrund von Wechselkursschwankungen), sodass die Anteile bei der Rückgabe mehr oder weniger wert sein können als bei der Zeichnung. Die Performance ist nach Abzug aller Fondsausgaben ausgewiesen, berücksichtigt jedoch keine Ausgabeaufschläge oder Korrespondenzbankgebühren und basiert auf einer Wiederanlage der Ausschüttungen. Bei einer Berücksichtigung dieser Gebühren wäre die Rendite niedriger ausgefallen. Die Performance anderer Anteilsklassen ist besser oder schlechter, abhängig von den Unterschieden bei Gebühren und Ausgabeaufschlägen. Soweit nichts anderes angegeben ist, haben alle in diesem Dokument verwendeten Definitionen dieselbe Bedeutung wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft.

Loomis, Sayles & Company, L.P.
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilinhaber

In unserer Funktion als Verwahrstelle der Gesellschaft haben wir die Tätigkeit der Natixis International Funds (Dublin) I plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr geprüft.

Der vorliegende Bericht einschließlich unseres Bestätigungsvermerks wurde einzig und allein für die Anteilinhaber der Gesellschaft in Übereinstimmung mit Teil 5 der Verordnungen der Europäischen Gemeinschaft (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities Regulations 2011) in der jeweils gültigen Fassung (die „OGAW-Verordnungen“) und für keinen anderen Zweck erstellt. Durch unseren Bestätigungsvermerk übernehmen wir keinerlei Verantwortung für jegliche andere Zwecke oder gegenüber jeglichen anderen Personen, denen dieser Bericht vorgelegt werden könnte.

Verantwortung der Verwahrstelle

Unsere Aufgaben und Pflichten werden in Teil 5 der OGAW-Verordnungen erklärt. Dazu gehören unter anderem die Prüfung der Tätigkeit der Gesellschaft in jedem Bilanzjahr und die Berichterstattung darüber für die Anteilinhaber.

Unser Bericht gibt an, ob die Gesellschaft unserer Meinung nach in diesem Berichtszeitraum im Einklang mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und der Satzung der Gesellschaft sowie den OGAW-Richtlinien geführt wurde. Die Gesellschaft ist letztlich dafür verantwortlich, dass diese Bestimmungen eingehalten werden. Sollte die Gesellschaft nicht für eine derartige Übereinstimmung gesorgt haben, ist es unsere Pflicht als Verwahrstelle, hierüber zu berichten und die von uns getroffenen Abhilfemaßnahmen aufzuführen.

Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle

Die Verwahrstelle führt Prüfungen durch, die sie für angemessen und notwendig erachtet, um ihren in Teil 5 der OGAW-Verordnungen aufgeführten Pflichten nachzukommen und um sicherzustellen, dass der Fonds in allen wesentlichen Punkten (i) im Einklang mit den Beschränkungen, die den Anlage- und Kreditaufnahmebefugnissen durch seine Gründungsdokumente und die anwendbaren Vorschriften auferlegt wurden, und (ii) auf sonstige Weise gemäß den Bestimmungen der Gründungsdokumente und den anwendbaren Regelungen geführt wurde.

Bestätigungsvermerk

Nach unserer Auffassung wurde die Gesellschaft während des Geschäftsjahres in allen wesentlichen Belangen in Übereinstimmung mit den folgenden Bestimmungen geführt:

(i) gemäß den in der Gründungsurkunde, der Satzung, den OGAW-Verordnungen und den Bestimmungen der Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „OGAW-Verordnungen der Zentralbank“) festgelegten Beschränkungen der Anlage- und Kreditbefugnisse der Gesellschaft und

(ii) anderweitig im Einklang mit den Bestimmungen in der Satzung und Gründungsurkunde, den OGAW-Verordnungen und den OGAW-Verordnungen der Zentralbank geführt wurde.

Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited
30 Herbert Street, Dublin
D02 W329
Irland

30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt seinen jährlichen Bericht zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss der Natixis International Funds (Dublin) I plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr vor.

Pflichten des Verwaltungsrats

Dem Verwaltungsrat obliegt die Erstellung des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit irischem Recht und den von der Europäischen Union (EU) anerkannten International Financial Reporting Standards (IFRS).

Nach irischem Gesellschaftsrecht ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Jahresabschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und der finanziellen Position der Gesellschaft zum Ende des Geschäftsjahres und der Gewinne oder Verluste der Gesellschaft für das jeweilige Geschäftsjahr vermittelt. Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat verpflichtet,

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden zu wählen und konsequent anzuwenden;
- angemessene und vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen vorzunehmen; und
- anzugeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Rechnungslegungsstandards erstellt wurde, und die entsprechenden Grundsätze anzugeben, vorbehaltlich dessen, dass wesentliche Abweichungen von diesen Grundsätzen offengelegt und im Anhang zum Abschluss erläutert werden; und
- den Jahresabschluss auf der Basis einer Fortführung der Geschäftstätigkeit zu erstellen, es sei denn, die Annahme einer fortgesetzten Geschäftstätigkeit wäre unangebracht.

Der Verwaltungsrat bestätigt, den vorstehend beschriebenen Anforderungen bei der Erstellung des Jahresabschlusses Genüge getan zu haben.

Der Verwaltungsrat zeichnet außerdem verantwortlich für die Sicherung der Vermögenswerte der Gesellschaft und für die Einleitung entsprechender Schritte, um betrügerisches Verhalten oder sonstige Unregelmäßigkeiten zu verhindern oder aufzudecken. Gemäß den OGAW-Verordnungen ist der Verwaltungsrat verpflichtet, die Vermögenswerte der Gesellschaft zur Verwahrung an eine Verwahrstelle zu übergeben. In Erfüllung ihrer Pflichten hat die Gesellschaft Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Verwahrstelle“) damit betraut, die Vermögenswerte der Gesellschaft zu verwahren. Die Verwahrstelle wird von der Central Bank of Ireland reguliert und untersteht deren Aufsicht.

Entsprechenserklärung des Verwaltungsrats

Die Gesellschaft verfolgt die Politik, ihre maßgeblichen Pflichten (gemäß Definition im Companies Act 2014) zu erfüllen. Wie gemäß Section 225(2) des Companies Act von 2014 erforderlich, bestätigt der Verwaltungsrat, dass er dafür verantwortlich ist, die Einhaltung der in Section 225 des Companies Act 2014 enthaltenen maßgeblichen Verpflichtungen durch die Gesellschaft sicherzustellen. Der Verwaltungsrat hat eine Compliance-Grundsatzerklärung im Sinne von Section 225(3)(a) des Companies Act von 2014 sowie eine Compliance-Richtlinie in Bezug auf die bestehenden Vorkehrungen und Strukturen erarbeitet, die nach Ansicht des Verwaltungsrats darauf ausgerichtet sind, die einschlägigen Verpflichtungen der Gesellschaft im Wesentlichen zu erfüllen. Diese Vorkehrungen und Strukturen wurden im Berichtszeitraum überprüft. Bei Wahrnehmung ihrer Aufgaben laut Abschnitt 225 stützten sich die Verwaltungsratsmitglieder unter anderem auf die geleisteten Dienste, Ratschläge und/oder Darstellungen Dritter, von denen die Verwaltungsratsmitglieder glauben, dass sie das erforderliche Wissen und die Erfahrung haben, um die Einhaltung der relevanten Verpflichtungen des Unternehmens zu gewährleisten. Diese relevanten Verpflichtungen unter Section 225 des Companies von Act 2014 gelten unabhängig von und zusätzlich zu den gesetzlichen und regulatorischen Auflagen, denen die Gesellschaft aufgrund der Regulierung durch die Central Bank of Ireland unterliegt.

Geschäftsbücher

Der Verwaltungsrat trägt dafür Sorge, dass die zur Erfüllung der Pflichten im Zusammenhang mit einer ordnungsgemäßen Buchführung erforderlichen Systeme und Verfahrensweisen Anwendung finden und die entsprechend kompetenten Fachleute und Dienstleistungsanbieter in Anspruch genommen werden. Zu diesem Zweck hat der Verwaltungsrat Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited (die „Verwaltungsstelle“) bestellt, um Buchhaltungs-, Verwaltungs- und Transferstellenaufgaben für den Fonds zu übernehmen. Die Geschäftsbücher werden von Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited, 30 Herbert Street, Dublin D02 W329, Irland, verwahrt. Die Verwaltungsstelle wird durch die Central Bank of Ireland reguliert und beaufsichtigt.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Hauptgeschäftstätigkeit

Ursprünglich wurde die Gesellschaft von der Central Bank als Investmentgesellschaft gemäß Teil 24 des Companies Act von 2014 zugelassen. Am 24. August 2000 wurde die Gesellschaft von der Zentralbank als Investmentgesellschaft gemäß den OGAW-Verordnungen zugelassen.

Die Anlageziele und -grundsätze der einzelnen Fonds sind auf den Seiten 7 bis 18 dargelegt.

Bisherige und künftige Geschäftsentwicklung

Der Bericht des Portfolioverwalters auf den Seiten 19 bis 25 bietet einen Überblick über die einzelnen Faktoren, die zur Performance jedes Fonds im Geschäftsjahr beigetragen haben. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles Multisector Income Fund sank um USD 44 Mio.; dies entspricht einem Rückgang um 7 %. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles High Income Fund sank um USD 2 Mio.; dies entspricht einem Rückgang um 21%. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund sank um USD 43 Mio.; dies entspricht einem Rückgang um 73%. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Alternative Risk Premia Fund stieg um USD 3 Mio.; dies entspricht einem Anstieg um 12 %. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles Euro High Yield Fund stieg um EUR 5 Mio.; dies entspricht einem Anstieg um 20 %. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles Euro Credit Fund stieg um EUR 23 Mio.; dies entspricht einem Anstieg um 23 %. Der Wert des Nettovermögens des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund stieg um EUR 460 Mio.; dies entspricht einem Anstieg um 116 %.

Der Verwaltungsrat erwartet keine Veränderungen an der Struktur oder den Anlagezielen des Loomis Sayles Multisector Income Fund, des Loomis Sayles High Income Fund, des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund*, des Loomis Sayles Euro High Yield Fund, des Loomis Sayles Euro Credit Fund und des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund. Unsere Standardpraxis umfasst die regelmäßige Überprüfung der Strukturen, Anlageziele und der Performance der Fonds vor dem Hintergrund der aktuellen Marktlandschaft und der Interessen der Anleger.

Informationen zur Performance der einzelnen Fonds seit Jahresbeginn finden Sie auf www.im.natixis.com.

Risikomanagement – Ziele und Strategien

Ein Investment in die Gesellschaft ist mit gewissen Risiken verbunden, zu denen unter anderem die in Erläuterung 13 des Jahresabschlusses aufgeführten und die im Verkaufsprospekt der Gesellschaft beschriebenen Risiken zählen.

Ergebnisse und Dividenden

Es wird beabsichtigt, dass die einzelnen Fonds Dividenden auf die Nettobetriebsertrag jedes Fonds in Höhe des operativen Nettoertrags des jeweiligen Fonds festlegen und ausschütten. Der aus den Anlagen der Gesellschaft erzielte Überschuss der realisierten Kapitalgewinne gegenüber den realisierten Kapitalverlusten wird von den jeweiligen Fonds ebenfalls ausgeschüttet.

Einzelheiten zu den von der Gesellschaft im Geschäftsjahr angekündigten Dividenden sind in der Gesamterfolgsrechnung aufgeführt.

Die Ergebnisse für das Geschäftsjahr sind in der Gesamterfolgsrechnung auf Seite 41 dargestellt.

Verwaltungsrat

Im Anschluss sind die Namen der Personen aufgeführt, die im am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahr Mitglieder des Verwaltungsrats waren.

Daniel Morrissey (Irland)
Jason Trepanier (USA)
Lynda Wood (geb. Schweitzer) (USA)
John Nolan (Irland)
Christopher Yiannakou (Vereinigtes Königreich)

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Secretary

Weder die Verwaltungsratsmitglieder noch der Secretary, einschließlich ihrer Familien, hielten im am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahr Beteiligungen an der Gesellschaf
*Der Fonds wurde am 5. März für Zeichnungen geschlossen.

Geschäftstransaktionen unter Mitwirkung der Verwaltungsräte oder des Secretary

Abgesehen von den in Erläuterung 12 zum Jahresabschluss genannten Transaktionen sind dem Verwaltungsrat keine wesentlichen Verträge oder Absprachen im Zusammenhang mit den Geschäftstransaktionen der Gesellschaft bekannt, im Rahmen derer die Mitglieder des Verwaltungsrates oder der Secretary in dem am 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahr eine nach dem Companies Act von 2014 definierte Beteiligung gehabt hätten.

Wie in dem von Irish Funds herausgegebenen Corporate Governance Code vorgesehen (s. u.), wurde jedem Verwaltungsratsmitglied von der Gesellschaft ein Ernennungsschreiben ausgestellt, das jeweils mit dreimonatiger Frist gekündigt werden kann.

Die im Geschäftsjahr an die Verwaltungsräte gezahlten Vergütungen sind in Erläuterung 3 zum Jahresabschluss ausgewiesen.

Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter

Die Gesellschaft beschäftigte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 keine Mitarbeiterinnen oder Mitarbeiter.

Relevante Audit-Informationen

Die amtierenden Verwaltungsratsmitglieder haben zum Zeitpunkt dieses Berichts jeweils folgendes bestätigt:

- seines/ihres Wissens nach gibt es keine relevanten Prüfinformationen, bei denen es sich um Informationen handelt, die vom Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Erstellung seines Berichts benötigt werden, die dem Abschlussprüfer der Gesellschaft nicht bekannt sind, und
- er/sie hat alle Schritte unternommen, die er/sie als Verwaltungsratsmitglied unternommen haben sollte, um sich über alle relevanten Prüfungsinformationen zu informieren und festzustellen, dass dem Abschlussprüfer der Gesellschaft diese Informationen bekannt sind.

Prüfungsausschuss

Der Verwaltungsrat erkennt an, dass er nach Section 167 des Companies Act 2014 verpflichtet ist, die Einsetzung eines Prüfungsausschusses zu erwägen. Die Verwaltungsratsmitglieder haben beschlossen, keinen Prüfungsausschuss einzusetzen, da nach Ansicht der Verwaltungsratsmitglieder zu diesem Zeitpunkt die Zuständigkeiten eines Prüfungsausschusses nach Section 167 (d. h. die Überwachung der internen Kontrolle, der internen Revision, des Risikomanagements, des Rechnungslegungsprozesses, der gesetzlichen Bestimmungen, Prüfungs- und gesetzlicher Abschlüsse, die Überprüfung und Überwachung der Unabhängigkeit der Abschlussprüfer sowie die Bereitstellung zusätzlicher Leistungen an die Gesellschaft durch die Abschlussprüfer) bereits aufgrund des Corporate-Governance-Regimes des Verwaltungsrats und der bestehenden Regelungen und Strukturen (einschließlich derjenigen Vereinbarungen, die auf der Ebene des Promoters und des Delegierten der Gesellschaft, bis zum 31. März 2024 Natixis Investment Managers S.A. und, ab dem 1. April 2024 Natixis Investment Managers International) entwickelt, um die Einhaltung der umfangreichen gesetzlichen und regulatorischen Verpflichtungen zu gewährleisten, die den OGAW-Investmentgesellschaften in Bezug auf die Geschäftsführung der Gesellschaft auferlegt wurden.

Vergütung

Um die Auflagen der OGAW-V-Richtlinie zu erfüllen, hat die Gesellschaft eine Vergütungspolitik eingeführt, die in Anbetracht der Größe und der internen Struktur der Gesellschaft sowie der Art, des Umfangs und der Komplexität ihrer Tätigkeiten als angemessen erachtet wird.

Der Gesamtbetrag der von der Gesellschaft für das Geschäftsjahr gezahlten Vergütung bezieht sich nur auf eine feste Vergütung. Während des Berichtzeitraums wurde keine variable Vergütung gezahlt.

Die feste Vergütung, die von der Gesellschaft an bestimmte Mitarbeiter gezahlt wurde, umfasst nur die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder, die ausschließlich an Herrn Daniel Morrissey und Herrn John Nolan in ihrer Eigenschaft als nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder gezahlt wird. Verwaltungsratsmitglieder, die auch Mitarbeiter von Natixis Investment Managers International Distribution (Jason Trepanier) und Loomis, Sayles & Company, L.P., dem Portfolioverwalter (Lynda Wood (geb. Schweitzer) und Christopher Yiannakou) sind, erhalten keine Vergütung von der Gesellschaft. Einzelheiten zu den gezahlten Verwaltungsratsvergütungen sind in Erläuterung 3 aufgeführt.

Die Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder wird auf der Grundlage einer vereinbarten Jahresvergütung berechnet. Die Vergütungsrichtlinie wurde einer internen Überprüfung unterzogen, und es wurde im laufenden Geschäftsjahr keine Änderung vorgenommen. Kopien der Vergütungsrichtlinien der Gesellschaft und des Portfolioverwalters finden Sie in Anhang I.

Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Unabhängige Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Chartered Accountants & Registered Auditors, haben ihrer Bereitschaft Ausdruck verliehen, die Tätigkeit als unabhängige Abschlussprüfer in Übereinstimmung mit Section 383 (2) des Companies Act aus dem Jahr 2014 fortzusetzen.

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Nach Abschluss des Geschäftsjahres waren nur die in Erläuterung 19 genannten Ereignisse zu verzeichnen.

Corporate-Governance-Erklärung

Die Gesellschaft unterliegt der irischen Gesetzgebung, bestehend aus dem Companies Act 2014 sowie den OGAW-Verordnungen der Zentralbank.

Die Gesellschaft hat freiwillig den Corporate-Governance-Code von Irish Funds („Irish Funds Code“) übernommen, der am 1. Januar 2012 in Kraft trat. Mit diesem Schritt zeigt die Gesellschaft, dass sie über solide Corporate-Governance-Strukturen verfügt. Hierzu zählen eine klare Organisationsstruktur mit genau festgelegten, transparenten und einheitlichen Verantwortlichkeiten, wirksamen Verfahren zur Ermittlung, Steuerung, Überwachung und Meldung der Risiken, denen die Gesellschaft ausgesetzt ist oder ausgesetzt sein könnte, und geeignete interne Kontrollmechanismen, darunter solide Verwaltungs- und Rechnungslegungsprozesse, die mit einem robusten und wirksamen Risikomanagement im Einklang stehen. Der Irish Funds Code ist auf der Irish Funds-Website verfügbar.[1]

Verbundene Personen

Gemäß den OGAW-Verordnungen muss unter anderem jede Transaktion mit einem OGAW von einer Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle und den Beauftragten oder Unterbeauftragten dieser Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (außer nicht zur Gruppe gehörenden Unterverwahrstellen, die von der Verwahrstelle ernannt werden) sowie mit deren verbundenen oder zu ihrer Gruppe gehörenden Unternehmen („verbundene Personen“) so ausgeführt werden, als wären sie zu marktüblichen Bedingungen ausgehandelt worden. Die Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilinhaber der Gesellschaft erfolgen. Diese Transaktionen umfassen im Namen der Gesellschaft durchgeführte Transaktionen von verbundenen Personen, zu denen der Verwaltungsrat keinen direkten Zugang hat und in Bezug auf welche der Verwaltungsrat sich auf die Zusicherungen seiner Beauftragten verlassen muss, dass die verbundenen Personen die Durchführung dieser Transaktionen auf einer ähnlichen Basis vornehmen.

Anteilinhaber sollten die Governance-Struktur der Gesellschaft berücksichtigen, die im Abschnitt zur Unternehmensführung in diesem Bericht des Verwaltungsrates ausführlicher beschrieben, sowie die Rollen und Zuständigkeiten der jeweiligen Delegierten der Gesellschaft unter der Oberaufsicht des Verwaltungsrates. Ferner sollten Anteilinhaber den Prospekt konsultieren, der viele der Transaktionen mit verbundenen Parteien ausweist und die allgemeine Natur der vertraglichen Vereinbarungen mit den wesentlichen verbundenen Personen erläutert; dabei werden jedoch nicht alle Transaktionen mit verbundenen Parteien angegeben. Zudem sollten Anteilsinhaber auch die Bestimmungen des Prospekts im Hinblick auf Interessenkonflikte beachten.

Unter Berücksichtigung der Bestätigungen der Geschäftsleitung der Gesellschaft sowie ihrer relevanten Beauftragten ist der Verwaltungsrat der Gesellschaft daher der Auffassung, dass:

(i) Vereinbarungen (die durch schriftliche Dokumente nachweisbar sind) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass die in den OGAW-Verordnungen genannten Pflichten in Bezug auf alle Transaktionen mit verbundenen Personen erfüllt werden, und dass

(ii) die in den OGAW-Verordnungen genannten Pflichten bei allen im Berichtszeitraum mit verbundenen Personen abgeschlossenen Transaktionen erfüllt wurden.

[1] https://files.irishfunds.ie/1432820468-corporate-governance-code-for-collective-investment-schemes-and-management-companies.pdf

Verbundene Personen (Fortsetzung)

Erläuterung 12 enthält Angaben zu Transaktionen mit verbundenen Parteien im Geschäftsjahr wie gemäß den maßgeblichen Rechnungslegungsstandards vorgeschrieben. Anteilinhaber sollten sich jedoch der Tatsache bewusst sein, dass nicht alle „verbundenen Personen“ unbedingt auch verbundene Parteien im Sinne dieser Rechnungslegungsstandards sein müssen. Details zu Zahlungen an verbundene Parteien und bestimmte verbundene Personen sind in Erläuterungen 3, 6, 7, 9 und 12 aufgeführt.

Im Namen des Verwaltungsrats

Mitglied des Verwaltungsrats

Mitglied des Verwaltungsrats

30. April 2024

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer an die Mitglieder der Natixis International Funds (Dublin) I plc (die „Gesellschaft")

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Bestätigungsvermerk

Wir sind der Auffassung, dass der Jahresabschluss von Natixis International Funds (Dublin) I plc:

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage der Gesellschaft und der Fonds zum 31. Dezember 2023 sowie ihrer Ergebnisse und Kapitalflüsse in dem an diesem Tag abgelaufenen Geschäftsjahr vermittelt;
- ordnungsgemäß im Einklang mit den von der Europäischen Union (EU) anerkannten International Financial Reporting Standards („IFRS") erstellt wurde; und
- ordnungsgemäß im Einklang mit den Erfordernissen des Companies Act 2014 und den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung erstellt wurde.

Wir haben den Abschluss geprüft, der im Jahresbericht und im geprüften Jahresabschluss enthalten ist. Dieser umfasst:

- die Bilanz zum 31. Dezember 2023;
- die Gesamtergebnisrechnung für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Kapitalflussrechnung für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Entwicklung des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr;
- die Aufstellung des Wertpapierbestands der einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2023; und
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft und ihre einzelnen Fonds, die eine Beschreibung der Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

Grundlage für die Stellungnahme

Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Ireland) („ISAs (Ireland)") und geltendem Recht durchgeführt.

Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen der ISAs (Ireland) sind im Abschnitt „Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses" unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um unsere Beurteilung zu begründen.

Unabhängigkeit

Wir haben gemäß den in Irland für unsere Abschlussprüfung maßgeblichen ethischen Anforderungen, darunter dem IAASA Ethical Standard, unsere Unabhängigkeit gegenüber der Gesellschaft gewahrt und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen Anforderungen gerecht geworden.

Schlussfolgerungen zur Unternehmensfortführung

Im Rahmen unserer Prüfung haben wir keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds aufwerfen, für einen Zeitraum von mindestens zwölf Monaten ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung genehmigt wird, weiter zu bestehen.

Bei der Prüfung des Abschlusses sind wir zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung für die Erstellung des Abschlusses angemessen ist.

Da es jedoch nicht möglich ist, alle künftigen Ereignisse oder Schlussfolgerung vorherzusagen, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft bzw. der Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs.

Unsere Verantwortlichkeiten und die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats im Hinblick auf die Unternehmensfortführung werden in den jeweiligen Abschnitten dieses Berichts beschrieben.

Berichterstattung über sonstige Informationen

Die sonstigen Informationen umfassen alle im Jahresbericht und im geprüften Abschluss enthaltenen Informationen, die nicht zum Abschluss und unserem diesbezüglichen Prüfungsbericht gehören. Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir auch weder einen Bestätigungsvermerk noch, sofern in diesem Bericht nicht ausdrücklich etwas anderes angegeben ist, eine Zusicherung jeglicher Art darüber ab. In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Kenntnissen enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir offensichtliche wesentliche Widersprüchlichkeiten oder wesentliche Fehldarstellungen feststellen, sind wir verpflichtet, Verfahren durchzuführen, um zu bestimmen, ob eine wesentliche Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir aufgrund der von uns geleisteten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser weiteren Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese Tatsache zu melden. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Im Hinblick auf den Bericht des Verwaltungsrats haben wir zudem geprüft, ob die vom Companies Act 2014 geforderten Angaben enthalten sind.

Beruhend auf den oben beschriebenen Verantwortlichkeiten und unserer Arbeit im Rahmen der Abschlussprüfung sind wir gemäß den ISAs (Ireland) und dem Companies Act 2014 zudem verpflichtet, bestimmte Meinungen und Sachverhalte, wie nachfolgend beschrieben, offenzulegen:

- Nach unserer Ansicht und auf Basis unserer Tätigkeiten im Rahmen der von uns durchgeführten Prüfung stimmen die im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 enthaltenen Informationen mit dem Abschluss überein. Der Bericht wurde gemäß den geltenden gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf der Grundlage unseres Wissens und unserer Kenntnisse über die Gesellschaft und ihr Umfeld, die wir im Laufe unserer Prüfung des Abschlusses erlangt haben, konnten wir keine wesentlichen falschen Darstellungen im Bericht des Verwaltungsrats feststellen.

Verantwortung für den Abschluss und die Prüfung

Verantwortung des Verwaltungsrats für den Abschluss

Wie in der Erklärung der Verantwortung des Verwaltungsrates auf Seite 29 ausführlicher erläutert, ist der Verwaltungsrat verantwortlich für die Erstellung des Jahresabschlusses gemäß dem geltenden Rahmenwerk und dafür, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild vermittelt.

Der Verwaltungsrat ist außerdem für interne Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die er für notwendig erachtet, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Fehldarstellungen sind, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Anwendung des Fortführungsprinzips offenlegen muss, sofern der Verwaltungsrat nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses

Unsere Zielsetzung ist es, eine hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine angemessene Überzeugung ist ein hohes Maß an Überzeugung, es besteht jedoch keine Garantie dafür, dass eine im Einklang mit den ISAs (Ireland) durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden erheblichen Falschaussagen aufdeckt. Fehldarstellungen können sich aus Betrug oder Irrtümern ergeben und gelten als wesentlich, wenn mit angemessener Sicherheit davon ausgegangen werden kann, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die wirtschaftlichen Entscheidungen der Leser dieses Abschlusses, die sie auf der Grundlage dieses Abschlusses treffen, beeinflussen könnten.

Zu den Prüfungen im Rahmen unserer Abschlussprüfung kann die Prüfung vollständiger Bestände bestimmter Transaktionen und Salden zählen, möglicherweise unter Verwendung von Datenprüfungstechniken. Üblicherweise wird jedoch eine beschränkte Anzahl von Elementen für die Prüfung ausgewählt, statt vollständige Bestände zu prüfen. Oftmals sind wir bestrebt, uns bei der Prüfung auf bestimmte Elemente zu konzentrieren, basierend auf deren Umfang oder Risikomerkmalen. In anderen Fällen führen wir eine stichprobenbasierte Prüfung durch, um Schlussfolgerungen hinsichtlich des Bestandes zu ziehen, aus dem die Stichprobe ausgewählt wurde.

Eine weitere Beschreibung unserer Verantwortlichkeiten für die Prüfung des Abschlusses finden sich auf der IAASA-Website unter

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

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Berichts des Abschlussprüfers.

Verwendung dieses Berichts

Dieser Bericht wurde in Übereinstimmung mit Paragraph 391 des Companies Act von 2014 erstellt und richtet sich mit seiner Einschätzung ausschließlich an die Anteilinhaber der Gesellschaft als Einheit und ist für keinen anderen Zweck bestimmt. Durch unseren Bestätigungsvermerk übernehmen wir - außer nach ausdrücklicher vorheriger schriftlicher Zusage unsererseits - keinerlei Verantwortung für jegliche andere Zwecke oder gegenüber jeglichen anderen Personen, in deren Hände dieser Bericht gelangen oder denen er vorgelegt werden könnte.

Sonstige Berichtspflichten

Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten gemäß dem Companies Act 2014

- Wir haben alle von uns zum Zwecke der Prüfung für notwendig erachteten Informationen und Erklärungen erhalten.
- Nach unserer Ansicht waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine schnelle und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
- Der Abschluss stimmt mit den Rechnungsunterlagen überein.

Ausnahmemeldungen gemäß dem Companies Act 2014

Vergütung und Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder

Gemäß dem Companies Act von 2014 müssen wir Ihnen mitteilen, wenn unserer Auffassung nach die von den Paragraphen 305 bis 312 dieses Gesetzes geforderten Angaben zur Vergütung und den Transaktionen der Verwaltungsratsmitglieder nicht gemacht wurden. Wir haben diesbezüglich keine Ausnahmen zu melden.

Sonstiges

Neben unserer Aufgabe, den Jahresabschluss gemäß dem irischen Recht und den ISA (Irland) zu prüfen und einen entsprechenden Bestätigungsvermerk für diesen Abschluss zu erteilen, wurden wir vom Verwaltungsrat aufgefordert, für den Jahresabschluss auch einen Bestätigungsvermerk gemäß den allgemein anerkannten Prüfungsgrundsätzen in den USA zu erteilen, die vom American Institute of Certified Public Accountants (AICPA) herausgegeben werden, um die Anforderungen von Rule 206(4)-2 des Investment Advisers Act von 1940 (die „Custody Rule“) zu erfüllen. Zu diesem Punkt haben wir auf den Seiten 30 bis 31 separat Stellung genommen.

Vincent MacMahon
Im Namen und Auftrag von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm
Dublin, Irland
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bericht der unabhängigen Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

An die Verwaltungsratsmitglieder der Natixis International Funds (Dublin) I plc

Bestätigungsvermerk

Wir haben den beigefügten Jahresabschluss der Gesellschaft und der einzelnen Fonds geprüft, der die Aufstellung der Finanzlage der Gesellschaft und der Fonds umfasst, einschließlich der Aufstellung der Wertpapierbestände der einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022, sowie die dazugehörige Aufstellung des Gesamtergebnisses, die Entwicklung des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens und die Kapitalflussrechnung der Gesellschaft und der einzelnen Fonds, einschließlich der dazugehörigen Erläuterungen für die zu diesem Zeitpunkt abgeschlossenen Geschäftsjahre (zusammenfassend als der „Jahresabschluss" bezeichnet).

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Jahresabschluss in allen wesentlichen Belangen ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Finanzlage der Gesellschaft und der einzelnen Fonds zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 sowie der Ertragslage, der Veränderungen des Nettovermögens und des Kapitalflusses für die zu diesem Zeitpunkt abgeschlossenen Geschäftsjahre in Übereinstimmung mit den International Financial Reporting Standards („IFRS"), wie sie in der Europäischen Union anzuwenden sind.

Grundlage für die Stellungnahme

Unsere Prüfung erfolgte in Übereinstimmung mit den allgemein anerkannten Prüfungsgrundsätzen in den USA (US GAAS). Unsere Verpflichtungen im Rahmen dieser Standards sind im Abschnitt „Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses" unseres Berichts näher beschrieben. Wir sind verpflichtet, unabhängig von der Gesellschaft zu sein und unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß den einschlägigen ethischen Anforderungen in Bezug auf unsere Abschlussprüfung gerecht zu werden. Wir sind der Meinung, dass die von uns erhaltenen Prüfungsnachweise ausreichend und angemessen sind, um eine Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu bilden.

Verantwortung der Geschäftsleitung für den Jahresabschluss

Die Geschäftsleitung ist verantwortlich für die Erstellung und sachgerechte Darstellung des Jahresabschlusses in Übereinstimmung mit irischem Recht und den von der Europäischen Union anerkannten IFRS sowie für die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems mit Bezug auf die Erstellung und sachgerechte Darstellung des Jahresabschlusses, die frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben aufgrund von Betrug oder Irrtum ist.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist die Geschäftsleitung dafür verantwortlich, die Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Anwendung des Fortführungsprinzips offenlegen muss, sofern die Geschäftsleitung nicht die Auflösung der Gesellschaft oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

Verantwortung der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses

Unsere Zielsetzung ist es, eine hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, und einen Prüfbericht zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine angemessene Überzeugung ist ein hohes Maß an Überzeugung, es besteht jedoch keine absolute Überzeugung und es besteht daher keine Garantie dafür, dass eine im Einklang mit den US GAAS durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden erheblichen Falschaussagen aufdeckt. Das Risiko, keine wesentlichen falschen Angaben aufgrund von Betrug aufzudecken, ist höher als bei einem Fehler, da Betrug Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, falsche Darstellungen oder die Aufhebung der internen Kontrolle beinhalten kann. Falsche Angaben werden als wesentlich angesehen, wenn eine erhebliche Wahrscheinlichkeit besteht, dass sie einzeln oder insgesamt das Urteil eines vernünftigen Nutzers auf der Grundlage des Abschlusses beeinflussen würden.

Bei der Durchführung einer Prüfung in Übereinstimmung mit den US GAAS:

- Wenden wir während der gesamten Prüfung professionelles Urteilsvermögen und professionelle Skepsis an.
- Identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Irrtum beruhen, und planen und führen wir Prüfungshandlungen durch, die diesen Risiken Rechnung tragen. Diese Verfahren umfassen die stichprobenartige Untersuchung der im Jahresabschluss ausgewiesenen Beträge und Angaben.
- Erlangen wir ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollen, um Prüfungsverfahren zu entwerfen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht, um ein Urteil über die Wirksamkeit der internen Kontrolle der Gesellschaft und jedes ihrer Fonds abzugeben. Dementsprechend wird eine solche Stellungnahme nicht abgegeben.
- Beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und die Angemessenheit der von der Geschäftsführung vorgenommenen wesentlichen buchhalterischen Schätzungen sowie die Gesamtdarstellung des Jahresabschlusses.
- Ziehen wir die Schlussfolgerung, ob nach unserem Ermessen Bedingungen oder Ereignisse vorliegen, die in ihrer Gesamtheit erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und des Fonds zur Fortführung der Geschäftstätigkeit über einen angemessenen Zeitraum aufwerfen.

Wir sind verpflichtet, mit den für die Unternehmensführung Verantwortlichen unter anderem über den geplanten Umfang und den Zeitplan der Prüfung, wesentliche Prüfungsfeststellungen und bestimmte mit der internen Kontrolle zusammenhängende Sachverhalte, die wir während der Prüfung festgestellt haben, zu kommunizieren.

Sonstige Informationen:

Die Geschäftsführung ist für die sonstigen im Jahresbericht und geprüften Jahresabschluss (der „Jahresbericht“) enthaltenen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, nicht aber den Jahresabschluss und unseren diesbezüglichen Prüfungsbericht. Unser Bestätigungsvermerk erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir geben weder einen Bestätigungsvermerk noch eine Zusicherung darüber ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses obliegt es unserer Verantwortung, die sonstigen Informationen zu lesen und zu prüfen, ob eine wesentliche Unstimmigkeit zwischen den sonstigen Informationen und dem Jahresabschluss besteht oder die sonstigen Informationen anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir auf der Grundlage der durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss kommen, dass eine unkorrigierte wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, diese in unserem Bericht zu beschreiben.

Einschränkung der Verwendung

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für den Verwaltungsrat in Bezug auf die für die Gesellschaft geltenden Vorschriften von Rule 206(4)-2 des Anlageberatergesetzes (Investment Advisers Act) 1940 („Custody Rule“) erstellt und dient keinem anderen Zweck. Durch unseren Bestätigungsvermerk übernehmen wir – außer nach ausdrücklicher vorheriger schriftlicher Zusage unsererseits – keinerlei Verantwortung für jegliche andere Zwecke oder gegenüber jeglichen anderen Personen, in deren Hände dieser Bericht gelangen oder denen er vorgelegt werden könnte.

PricewaterhouseCoopers
Dublin, Irland
30. April 2024

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bruttobeträge

Zum 31. Dezember 2023

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2022
UMLAUFVERMÖGEN									
Bankguthaben	1(a)(h),5	10.585.041	5.787.909	92.201	242.955	299.896	1.322.082	2.510.298	2.012.911
Einlagen bei Brokern für Sicherheiten für Derivate	1(h),5(a)	–	385.360	–	–	206.185	–	3.263.956	3.077.260
Debitoren	6	9.052.525	6.506.064	107.358	86.176	201.479	475.668	97.006	1.175.793
Kapitalanlagen: Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1(d),4	541.010.027	583.653.653	6.760.625	8.506.967	15.536.180	58.202.162	23.916.660	20.808.345
Gesamtvermögen		560.647.593	596.332.986	6.960.184	8.836.098	16.243.740	59.999.912	29.787.920	27.074.309
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
An Broker zahlbare Einlagen für Sicherheiten für Derivate	1(h), 5(a)	(3.374.858)	–	–	–	–	(41.198)	–	–
Kreditoren – (innerhalb eines Geschäftsjahres fällige Beträge)	7	(2.886.519)	(2.973.395)	(109.009)	(208.775)	(139.011)	(200.258)	(96.349)	(1.441.353)
Kapitalanlagen: Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1(d),4	(5.208.855)	(573.309)	(46.208)	(188)	(85.932)	(1.026.200)	(1.532.955)	(587.857)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN		549.177.361	592.786.282	6.804.967	8.627.135	16.018.797	58.732.256	28.158.616	25.045.099
Zum 31. Dezember 2022		592.786.282	592.786.282	8.627.135	8.627.135	58.732.256	58.732.256	25.045.099	25.045.099
Zum 31. Dezember 2021		819.775.029	819.775.029	16.489.497	16.489.497	81.275.147	81.275.147	30.183.827	30.183.827
Zum 31. Dezember 2020		1.000.775.311	1.000.775.311	18.692.099	18.692.099	192.280.202	192.280.202	31.326.728	31.326.728

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Bilanz (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	SUMME USD 31. Dezember 2023	SUMME USD 31. Dezember 2022
UMLAUFVERMÖGEN									
Bankguthaben	1(a)(h),5	1.339.347	1.155.055	1.530.215	1.177.081	5.902.648	5.128.996	23.177.658	17.328.750
Einlagen bei Brokern für Sicherheiten für Derivate	1(h),5(a)	28.629	68.164	162.260	548.463	605.842	1.386.075	4.350.250	5.600.004
Debitoren	6	494.862	392.172	2.251.099	907.844	12.871.251	4.395.124	26.709.921	14.321.839
Kapitalanlagen: Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	1(d),4	31.115.070	26.020.249	121.549.862	99.591.878	842.724.263	388.796.035	1.686.780.166	1.220.173.238
Gesamtvermögen		32.977.908	27.635.640	125.493.436	102.225.266	862.104.004	399.706.230	1.741.017.995	1.257.423.831
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN									
An Broker zahlbare Einlagen für Sicherheiten für Derivate	1(h), 5 (a)	–	–	–	–	–	–	(3.374.858)	(41.198)
Kreditoren – (innerhalb eines Geschäftsjahres fällige Beträge)	7	(103.489)	(132.538)	(526.009)	(193.303)	(3.098.626)	(1.221.831)	(7.349.160)	(6.475.534)
Kapitalanlagen: Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	1(d),4	–	(61.116)	(173.427)	(369.193)	(1.293.600)	(1.053.447)	(8.494.501)	(3.771.093)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN		32.874.419	27.441.986	124.794.000	101.662.770	857.711.778	397.430.952	1.721.799.476	1.247.136.006
Zum 31. Dezember 2022		27.441.986	27.441.986	101.662.770	101.662.770	397.430.952	397.430.952	1.247.136.006	1.247.136.006
Zum 31. Dezember 2021		32.273.023	32.273.023	120.603.868	120.603.868	181.058.544	181.058.544	1.327.474.875	1.327.474.875
Zum 31. Dezember 2020								1.243.074.340	1.243.074.340

Im Namen des Verwaltungsrats

Verwaltungsratsmitglied
30. April 2024

Verwaltungsratsmitglied

Die Erläuterungen auf den Seiten 44 bis 125 sind integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

Vertraulich BPCE

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Gesamterfolgsrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2022
Anlageerträge	2	27.935.889	25.613.590	441.398	661.455	1.212.265	1.744.994	1.042.328	821.226
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	4	18.128.050	(126.057.445)	384.607	(2.760.051)	1.327.951	(16.163.074)	2.714.872	(3.972.752)
Summe der Anlageerträge		46.063.939	(100.443.855)	826.005	(2.098.596)	2.540.216	(14.418.080)	3.757.200	(3.151.526)
Operative Aufwendungen	3	(6.978.172)	(8.306.427)	(168.056)	(320.275)	(349.514)	(735.724)	(82.246)	(295.232)
Aufwandsrückerstattung	3	206.986	247.188	63.933	161.817	11.820	191.833	–	168.969
Operative Nettoaufwendungen		(6.771.186)	(8.059.239)	(104.123)	(158.458)	(337.694)	(543.891)	(82.246)	(126.263)
Operatives Ergebnis vor Finanzaufwand		39.292.753	(108.503.094)	721.882	(2.257.054)	2.202.522	(14.961.971)	3.674.954	(3.277.789)
Finanzaufwand									
Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	18	(4.199.587)	(4.095.783)	(188.563)	(909.961)	(184.084)	(5.175.712)	–	–
Finanzaufwand gesamt		(4.199.587)	(4.095.783)	(188.563)	(909.961)	(184.084)	(5.175.712)	–	–
Gewinn vor Steuern		35.093.166	(112.598.877)	533.319	(3.167.015)	2.018.438	(20.137.683)	3.674.954	(3.277.789)
Quellensteuer	11	(204.953)	(206.565)	(3.653)	(3.802)	(9.500)	(23.550)	(63.224)	(70.102)
Netto-Zunahme/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		34.888.213	(112.805.442)	529.666	(3.170.817)	2.008.938	(20.161.233)	3.611.730	(3.347.891)

Die Erläuterungen auf den Seiten 44 bis 125 sind integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Gesamterfolgsrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	SUMME USD 31. Dezember 2023	SUMME USD 31. Dezember 2022
Anlageerträge	2	1.374.942	834.201	3.839.301	1.515.589	20.537.573	5.731.606	59.078.624	37.466.133
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	4	1.995.285	(3.861.591)	6.737.857	(16.992.076)	35.263.355	(44.387.276)	71.156.210	(218.581.718)
Summe der Anlageerträge		3.370.227	(3.027.390)	10.577.158	(15.476.487)	55.800.928	(38.655.670)	130.234.834	(181.115.585)
Operative Aufwendungen	3	(189.900)	(218.093)	(897.223)	(543.955)	(3.696.019)	(2.147.552)	(12.861.686)	(12.762.929)
Aufwandsrückerstattung	3	74.905	115.676	560.800	257.823	2.181.970	1.303.206	3.395.284	2.559.271
Operative Nettoaufwendungen		(114.995)	(102.417)	(336.423)	(286.132)	(1.514.049)	(844.346)	(9.466.402)	(10.203.658)
Operatives Ergebnis vor Finanzaufwand		3.255.232	(3.129.807)	10.240.735	(15.762.619)	54.286.879	(39.500.016)	120.768.432	(191.319.243)
Finanzaufwand									
Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	18	–	–	(17.269)	–	–	–	(4.591.310)	(10.181.456)
Finanzaufwand gesamt		–	–	(17.269)	–	–	–	(4.591.310)	(10.181.456)
Gewinn vor Steuern		3.255.232	(3.129.807)	10.223.466	(15.762.619)	54.286.879	(39.500.016)	116.177.122	(201.500.699)
Quellensteuer	11	(2.996)	(902)	(13.755)	(3.743)	(93.915)	(24.497)	(403.577)	(335.120)
Netto-Zunahme/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.252.236	(3.130.709)	10.209.711	(15.766.362)	54.192.964	(39.524.513)	115.773.545	(201.835.819)

Alle Gewinne bzw. Verluste wurden in der Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen. Die vorgenannten Ergebniszahlen für das Geschäftsjahr beziehen sich auf fortgeführte Geschäfte.

Vertraulich BPCE

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Entwicklung des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2022
Auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallendes Nettovermögen zum 1. Januar 2023 (2022)		592.786.282	819.775.029	8.627.135	16.489.497	58.732.256	81.275.147	25.045.099	30.183.827
Netto-Zunahme/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		34.888.213	(112.805.442)	529.666	(3.170.817)	2.008.938	(20.161.233)	3.611.730	(3.347.891)
Anteilstransaktionen									
Erlöse aus ausgegebenen rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen[1]	8	99.410.737	165.879.957	121.452	1.604.828	8.105.430	12.660.097	–	2.606.874
Rücknahmeerlöse aus rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen[2]	8	(177.907.871)	(280.063.262)	(2.473.286)	(6.296.373)	(52.827.827)	(15.041.755)	(498.213)	(4.397.711)
Gesamtabnahme des Nettovermögens durch Anteilstransaktionen		(78.497.134)	(114.183.305)	(2.351.834)	(4.691.545)	(44.722.397)	(2.381.658)	(498.213)	(1.790.837)
Gesamtzuwachs/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens		(43.608.921)	(226.988.747)	(1.822.168)	(7.862.362)	(42.713.459)	(22.542.891)	3.113.517	(5.138.728)
Währungsberichtigung									
Auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallendes Nettovermögen zum 31. Dezember 2023 (2022)		549.177.361	592.786.282	6.804.967	8.627.135	16.018.797	58.732.256	28.158.616	25.045.099

Die Erläuterungen auf den Seiten 44 bis 125 sind integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Entwicklung des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	SUMME USD 31. Dezember 2023	SUMME USD 31. Dezember 2022
Auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallendes Nettovermögen zum 1. Januar 2023 (2022)		27.441.986	32.273.023	101.662.770	120.603.868	397.430.952	181.058.544	1.247.136.006	1.327.474.875
Netto-Zunahme/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit		3.252.236	(3.130.709)	10.209.711	(15.766.362)	54.192.964	(39.524.513)	115.773.545	(201.835.819)
Anteilstransaktionen									
Erlöse aus ausgegebenen rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen[1]	8	5.380.612	2.213.671	66.438.141	33.381.120	625.135.424	330.081.547	877.528.050	573.019.829
Rücknahmeerlöse aus rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen[2]	8	(3.200.415)	(3.913.999)	(53.516.622)	(36.555.856)	(219.047.562)	(74.184.626)	(538.330.561)	(428.164.096)
Gesamtzuwachs/(-abnahme) des Nettovermögens durch Anteilstransaktionen		2.180.197	(1.700.328)	12.921.519	(3.174.736)	406.087.862	255.896.921	339.197.489	144.855.733
Gesamtzuwachs/(-abnahme) des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens		5.432.433	(4.831.037)	23.131.230	(18.941.098)	460.280.826	216.372.408	454.971.034	(56.980.086)
Währungsberichtigung								19.692.436	(23.358.783)
Auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallendes Nettovermögen zum 31. Dezember 2023 (2022)		32.874.419	27.441.986	124.794.000	101.662.770	857.711.778	397.430.952	1.721.799.476	1.247.136.006

[1] Inkl. wiederangelegte Ausschüttungen in Höhe von USD 1.108.081 auf den Loomis Sayles Multisector Income Fund (31. Dezember 2022: USD 801.609), USD 69.002 auf den Loomis Sayles High Income Fund (31. Dezember 2022: USD 271.378), USD 25.405 auf den Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (31. Dezember 2022: USD 780.982), USD 0 auf den Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (31. Dezember 2022: USD 0), EUR 0 auf den Loomis Sayles Euro High Yield Fund (31. Dezember 2022: EUR 0), EUR 0 auf den Loomis Sayles Euro Credit Fund (31. Dezember 2022: EUR 0) und EUR 0 auf den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (31. Dezember 2022: EUR 0).

[2] Erlöse aus ausgegebenen rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen und Rücknahmeerlöse aus rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen umfassen eine Ertragsausgleichsanpassung von USD 0 auf den Loomis Sayles Multisector Income Fund (31. Dezember 2022: USD (721.405)), USD (24.912) auf den Loomis Sayles High Income Fund (31. Dezember 2022: USD (16.032)), USD (54.238) auf den Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (31. Dezember 2022: USD (11.060)), USD 0 auf den Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (31. Dezember 2022: USD 0), EUR 0 auf den Loomis Sayles Euro High Yield Fund (31. Dezember 2022: EUR 0), EUR 0 auf den Loomis Sayles Euro Credit Fund (31. Dezember 2022: EUR 0) und EUR 0 auf den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund (31. Dezember 2022: EUR 0).

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Kapitalflussrechnung

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD 31. Dezember 2022
Cashflow aus der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit								
Erwerb von finanziellen Vermögenswerten und Erfüllung finanzieller Verbindlichkeiten	(395.447.923)	(300.147.125)	(4.659.637)	(5.925.185)	(25.427.370)	(72.823.519)	(108.087.712)	(184.695.577)
Erlöse aus dem Verkauf von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Kapitalanlagen	460.745.192	388.921.351	6.777.145	10.929.637	68.481.035	78.044.794	108.694.527	184.380.710
Anleiheerträge	24.286.062	25.708.470	468.882	731.698	1.546.353	1.792.692	539.810	577.688
Erträge aus Einlagenzinsen	340.747	177.327	6.583	3.660	36.837	14.424	233.854	72.797
Sonstige Zinserträge	1.098.989	946.922	(58.903)	109.675	(156.992)	116.919	32.192	324.726
Operativer Aufwand	(6.458.095)	(8.232.497)	(176.668)	(123.393)	(435.067)	(525.503)	(230.375)	17.646
Nettomittelzufluss aus der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit	84.564.972	107.374.448	2.357.402	5.726.092	44.044.796	6.619.807	1.182.296	677.990
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit								
Erlöse aus der Ausgabe rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	97.871.333	164.659.876	52.450	1.353.467	8.130.781	11.823.885	–	2.606.874
Dividendenausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	(4.199.587)	(4.095.783)	(188.563)	(909.961)	(184.084)	(5.175.712)	–	–
Reinvestierte Dividenden	1.108.081	801.609	69.002	271.378	25.405	780.982	–	–
Zahlungen für Rücknahmen rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	(178.307.885)	(285.235.930)	(2.441.045)	(6.354.344)	(52.791.701)	(15.280.558)	(498.213)	(4.397.711)
Mittelabfluss aus der Finanzierungstätigkeit	(83.528.058)	(123.870.228)	(2.508.156)	(5.639.460)	(44.819.599)	(7.851.403)	(498.213)	(1.790.837)
Nettozunahme / (-abnahme) von Bargeld und bargeldähnlichen Instrumenten im Geschäftsjahr	1.036.914	(16.495.780)	(150.754)	86.632	(774.803)	(1.231.596)	684.083	(1.112.847)
Bargeld und bargeldähnliche Instrumente zum 1. Januar 2023 (2022)	6.173.269	22.669.049	242.955	156.323	1.280.884	2.512.480	5.090.171	6.203.018
Währungsberichtigung								
Bargeld und bargeldähnliche Instrumente zum 31. Dezember 2023 (2022)	7.210.183	6.173.269	92.201	242.955	506.081	1.280.884	5.774.254	5.090.171

Die Erläuterungen auf den Seiten 44 bis 125 sind integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Kapitalflussrechnung (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR 31. Dezember 2022	SUMME USD 31. Dezember 2023	SUMME USD 31. Dezember 2022
Cashflow aus der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit								
Erwerb von finanziellen Vermögenswerten und Erfüllung von finanziellen Verbindlichkeiten	(38.661.202)	(43.451.062)	(212.749.361)	(205.044.987)	(1.242.036.500)	(784.118.269)	(2.183.358.940)	(1.665.649.037)
Erlöse aus dem Verkauf von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Kapitalanlagen	35.500.550	45.001.782	197.333.468	206.346.408	824.438.723	528.060.689	1.812.614.232	1.494.100.618
Anleiheerträge	1.292.319	851.673	3.158.473	1.434.312	13.820.862	3.336.275	47.024.890	34.810.905
Erträge aus Einlagenzinsen	30.978	(2.240)	52.883	(10.329)	232.262	(15.996)	967.226	237.722
Sonstige Zinserträge	(28.087)	16.026	(102.087)	558	(475.875)	24.467	245.814	1.542.053
Operativer Aufwand	(136.777)	(21.571)	(256.816)	(192.699)	(961.740)	(586.699)	(8.797.374)	(9.718.580)
Nettomittelzufluss/(-abfluss) aus der gewöhnlichen Geschäftstätigkeit	(2.002.219)	2.394.608	(12.563.440)	2.533.263	(404.982.268)	(253.299.533)	(331.304.152)	(144.676.319)
Cashflow aus der Finanzierungstätigkeit								
Erlöse aus der Ausgabe rückzahlbarer gewinnberechtigten Anteile	5.354.658	2.214.841	65.811.163	33.660.616	623.525.706	332.182.061	873.445.559	573.253.489
Dividendenausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	(17.269)	–	–	–	(4.591.310)	(10.181.456)
Reinvestierte Dividenden	–	–	–	–	–	–	1.202.488	1.853.969
Zahlungen für Rücknahmen rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	(3.207.682)	(3.920.819)	(53.263.523)	(36.594.046)	(218.550.019)	(73.800.063)	(537.841.039)	(433.271.150)
Mittelzufluss/(-abfluss) aus der Finanzierungstätigkeit	2.146.976	(1.705.978)	12.530.371	(2.933.430)	404.975.687	258.381.998	332.215.698	131.654.852
Nettozunahme / (-abnahme) von Bargeld und bargeldähnlichen Instrumenten im Geschäftsjahr	144.757	688.630	(33.069)	(400.167)	(6.581)	5.082.465	911.546	(13.021.467)
Bargeld und bargeldähnliche Instrumente zum 1. Januar 2023 (2022)	1.223.219	534.589	1.725.544	2.125.711	6.515.071	1.432.606	22.887.556	36.195.322
Währungsberichtigung							353.947	(286.299)
Bargeld und bargeldähnliche Instrumente zum 31. Dezember 2023 (2022)	1.367.976	1.223.219	1.692.475	1.725.544	6.508.490	6.515.071	24.153.049	22.887.556

Die Erläuterungen auf den Seiten 44 bis 125 sind integraler Bestandteil dieses Abschlusses.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Im Folgenden sind die wichtigsten bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten Rechnungslegungsgrundsätze aufgeführt. Sofern in den folgenden Abschnitten nichts Anderweitiges angegeben ist, wurden diese Grundsätze für alle angegebenen Berichtszeiträume verwendet.

a) Grundlagen der Darstellung

Der Halbjahresabschluss wurde im Einklang mit den von der Europäischen Union anerkannten IFRS („IFRS“) sowie im Einklang mit der irischen Gesetzgebung, bestehend aus dem Companies Act 2014, und den OGAW-Verordnungen erstellt. Der Abschluss wurde nach dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, das entsprechend um die Wertveränderungen der als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten angepasst wurde.

Die Erstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den IFRS erfordert den Einsatz einiger entscheidender Schätzwerte. Darüber hinaus muss der Verwaltungsrat bei der Anwendung der Rechnungslegungsgrundsätze der Gesellschaft nach eigenem Urteil handeln. Die Bereiche, in denen in hohem Maße ein eigenes Urteil erforderlich ist oder die äußerst komplex sind, sowie Bereiche, in denen sich Annahmen und Schätzungen erheblich auf den Abschluss auswirken, sind in Erläuterung 1(b) aufgeführt.

Der Portfolioverwalter ist bei der Securities and Exchange Commission („SEC“) in den Vereinigten Staaten als Anlageberater eingetragen und wird von dieser beaufsichtigt. Die Gesellschaft ist der Auffassung, dass keine wesentlichen Unterschiede zwischen IFRS und entsprechenden Angaben gemäß den U.S. Generally Accepted Accounting Principles („US GAAP“) bestehen, die einer Abstimmung zum Zwecke von SEC Custody Rule 206 bedürfen.

Der Loomis Sayles Multisector Income Fund ist gemäß Section 104 der Securities and Futures Ordinance (die „SFO“) von Hongkong zugelassen und unterliegt den Anforderungen des Code on Unit Trusts and Mutual Funds.

Die Gesellschaft ist der Auffassung, dass dieser Abschluss gemäß den gesetzlichen Anforderungen in Hongkong erstellt wurde.

Die Gesellschaft hat keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder gemeinsam erhebliche Zweifel an der Fähigkeit der Gesellschaft und der Fonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit aufwerfen können.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist die Gesellschaft zu dem Schluss gekommen, dass die Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung als Grundlage der Rechnungslegung für die Erstellung des Abschlusses angemessen ist. Da es jedoch nicht möglich ist, alle künftigen Ereignisse oder Schlussfolgerung vorherzusagen, ist diese Erklärung keine Garantie für die Fähigkeit der Gesellschaft bzw. der Fonds zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs.

(i) Standards und Änderungen bestehender Standards, die am 1. Januar 2023 in Kraft traten

Es existieren keine neuen Standards, Änderungen an Standards oder Interpretationen, die für das Geschäftsjahr ab dem 1. Januar 2023 erstmals in Kraft treten und wesentliche Auswirkungen auf den Abschluss des Fonds haben.

(ii) Neue Standards, Änderungen und Interpretationen, die nach dem 1. Januar 2023 in Kraft traten.

Es gibt keine neuen Standards, Änderungen von Standards und Interpretationen, die noch nicht in Kraft getreten sind und die einen wesentlichen Einfluss auf den Abschluss des Fonds hätten.

b) Wesentliche Schätzungen und Annahmen bei der Rechnungslegung

Die Geschäftsleitung macht Schätzungen und trifft Annahmen, die zukunftsbezogen sind. Die daraus resultierenden rechnungslegungsbezogenen Schätzungen entsprechen definitionsgemäß selten den damit verbundenen tatsächlichen Ergebnissen, und die Unterschiede können wesentlich sein. Für folgende Schätzungen und Annahmen besteht ein beträchtliches Risiko, dass eine wesentliche Berichtigung der Buchwerte der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten erforderlich ist:

(i) Beizulegender Zeitwert von derivativen Finanzinstrumenten
Die Gesellschaft kann gelegentlich Finanzinstrumente halten, die nicht an aktiven Märkten notieren, beispielsweise außerbörslich gehandelte Derivate (Over-the-Counter- (OTC-)Derivate). Der Wert von Over-the-Counter- (OTC-)Derivaten ist mindestens täglich zu ermitteln und basiert auf einem von der Gegenpartei stammenden Preis oder einer alternativen Bewertung. Eine solche alternative Bewertung muss von einer kompetenten Person (beispielsweise vom Portfolioverwalter) vorgenommen werden, die von der Gesellschaft ernannt und von der Verwahrstelle zu diesen Zwecken ermächtigt wurde. Es kann auch eine Bewertung auf anderen Wegen erfolgen, sofern die Verwahrstelle den entsprechenden Wert genehmigt.

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

b) Wesentliche Schätzungen und Annahmen bei der Rechnungslegung (Fortsetzung)

Wird ein Derivat auf andere Weise bewertet, befolgt die Gesellschaft internationale Best Practices und beachtet die Grundsätze für die Bewertung von OTC-Instrumenten, die von Stellen wie der International Organisation of Securities Commissions (IOSCO) und der Alternative Investment Management Association (AIMA) aufgestellt werden. Eine solche alternative Bewertung, die von einer kompetenten, vom Verwaltungsrat ernannten und von der Verwahrstelle zu diesem Zweck anerkannten Person vorgenommen wird, ist mindestens monatlich mit der Bewertung durch die Gegenpartei abzustimmen; etwaige wesentliche Differenzen müssen umgehend untersucht und begründet werden;

(ii) Beizulegender Zeitwert von nicht an aktiven Märkten gehandelten Wertpapieren
Der Wert einer Anlage, die nicht an einem geregelten Markt notiert ist oder regulär gehandelt wird, entspricht ihrem voraussichtlichen Veräußerungswert, der von einer (zu diesem Zweck von der Verwahrstelle anerkannten) sachkundigen Person, Firma oder Einrichtung, die als Market Maker für diese Anlage auftritt, bzw. von irgendeiner anderen vom Verwaltungsrat als sachkundig eingestuften (und zu diesem Zweck von der Verwahrstelle anerkannten) Person sorgfältig und nach bestem Wissen und Gewissen geschätzt wird.

c) Wichtige Festlegungen: Funktionale Währung

Nach Einschätzung des Verwaltungsrats ist der US-Dollar die Währung, die am besten die wirtschaftlichen Auswirkungen auf die zugrunde liegenden Transaktionen, Ereignisse und Bedingungen repräsentiert. Der US-Dollar ist die Währung, in der die Gesellschaft ihre Performance misst und ihre Ergebnisse ausweist.

d) Zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Die Gesellschaft hat sämtliche Kapitalanlagen als „erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten" kategorisiert. Diese Kategorie besteht aus zwei Teilkategorien: Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, sowie jene, die vom Verwaltungsrat beim erstmaligen Ansatz als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewerten designiert werden.

Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden in erster Linie mit der Absicht eines kurzfristigen Verkaufs und Rückkaufs erworben. Auch Derivate werden als „zu Handelszwecken gehalten" eingestuft, da die Gesellschaft Derivate (mit Ausnahme von Devisenterminkontrakten) nicht als Absicherungsinstrument designiert.

Der marktübliche Kauf bzw. Verkauf von Kapitalanlagen wird zum Handelstag – d.h. dem Tag, an dem die Fonds die Verpflichtung zum Kauf oder Verkauf des Vermögenswertes eingehen – bilanziert. Kapitalanlagen werden beim erstmaligen Ansatz mit ihrem beizulegenden Zeitwert bewertet. Anfallende Transaktionskosten für alle erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden in den Aufwand gebucht. Kapitalanlagen werden ausgebucht, wenn die Rechte auf den Bezug von Cashflows aus diesen Kapitalanlagen ausgelaufen sind oder die Fonds im Wesentlichen alle Risiken und Chancen, die mit dem Eigentum der Kapitalanlagen verbunden sind, übertragen haben.

Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte werden in der Gesamterfolgsrechnung im Zeitraum ihrer Entstehung ausgewiesen. Zinserträge aus als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten werden anhand der Effektivzinsmethode berechnet und in der Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen.

e) Zum beizulegenden Zeitwert bewertete Kapitalanlagen

Als beizulegender Zeitwert von an aktiven Märkten gehandelten finanziellen Vermögenswerten (etwa öffentlich gehandelte Derivate sowie zu Handelszwecken gehaltene Wertpapiere) wird der Marktpreis zum Bilanzstichtag zu Grunde gelegt. Hält ein Fonds Derivate mit sich ausgleichendem Marktrisiko, wird als beizulegender Zeitwert für die sich kompensierenden Risikopositionen der Mittelkurs verwendet. Die Bewertung nicht börsennotierter Wertpapiere erfolgt mithilfe von externen Preisanbietern, von Broker-Quotierungen oder von Fair-Value-Methoden, die vom Pricing Oversight Committee des Portfolioverwalters genehmigt wurden.

Existiert kein aktiver Markt für ein Finanzinstrument, kann der Verwaltungsrat den beizulegenden Zeitwert mithilfe eines Bewertungsverfahrens ermitteln. Die Fonds setzen zahlreiche Verfahren ein und treffen Annahmen, die auf den zum jeweiligen Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen basieren.

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

e) Zum beizulegenden Zeitwert bewertete Kapitalanlagen (Fortsetzung)

Zu den Bewertungsmethoden gehören die Verwendung der jüngsten Geschäftsvorfälle zwischen unabhängigen Geschäftspartnern, der Vergleich mit dem aktuellen beizulegenden Zeitwert eines anderen, im Wesentlichen identischen Finanzinstruments, Discounted-Cashflow-Verfahren, Optionspreismodelle oder jegliche andere Bewertungsmethode, die verlässliche Schätzwerte von Preisen liefert, die bei aktuellen Marktvorgängen erzielt werden.

Im Loomis Sayles Multisector Income Fund wurde zum 31. Dezember 2023 eine Kapitalanlage mit den zuvor beschriebenen Bewertungsmethoden mit einem Marktwert von USD 74.270 bewertet (31. Dezember 2022: zwei Kapitalanlagen mit einem Marktwert von USD 91.582); das entspricht 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,02 %) des Nettoinventarwerts. Im Loomis Sayles High Income Fund wurde eine Kapitalanlage mit den zuvor beschriebenen Bewertungsmethoden mit einem Marktwert von USD 45.164 bewertet (31. Dezember 2022: eine Kapitalanlagen mit einem Marktwert von USD 46.570), das entspricht 0,66 % (31. Dezember 2022: 0,54 %) des Nettoinventarwerts.

Anlagefonds
Der beizulegende Zeitwert einer Anlage, die ein Anteil oder eine Beteiligung an einem offenen kollektiven Anlageplan/Fonds ist, entspricht dem letzten verfügbaren ungeprüften Nettoinventarwert eines solchen Anteils oder einer solchen Beteiligung. Anteile oder Aktien an börsengehandelten Fonds werden zum letzten verfügbaren Nettoinventarwert oder, wenn sie an einem geregelten Markt notiert oder gehandelt werden, zum letzten notierten Handelskurs bewertet.

f) Devisengeschäfte

Der beizulegende Zeitwert von offenen Devisentermin- und Devisenkassageschäften wird ermittelt als Differenz zwischen dem Kurs, der dem Kontrakt zugrunde liegt, und dem aktuellen Terminkurs zur Glattstellung des Kontrakts am Bewertungstag. Nettogewinne bzw. -verluste aus erfüllten Kontrakten sind in der Gesamterfolgsrechnung der betreffenden Fonds ausgewiesen. Gewinne oder Verluste aus offenen Devisenterminkontrakten werden als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte bzw. Verbindlichkeiten in der Bilanz des jeweiligen Fonds erfasst.

Am Geschäftsjahresende eingetretene Veränderungen der Gewinne bzw. Verluste werden in der Gesamterfolgsrechnung des jeweiligen Fonds ausgewiesen. Gewinne bzw. Verluste auf offene Devisenkassageschäfte werden in der Bilanz erfasst, und Veränderungen der Gewinne bzw. Verluste seit Ende des vorangegangenen Geschäftsjahres werden in der Gesamterfolgsrechnung der jeweiligen Teilfonds ausgewiesen. Bei Absicherungen auf Ebene der Anteilsklasse werden die Gewinne oder Verluste nur der jeweiligen Anteilsklasse zugewiesen.

g) Futures-Kontrakte

Futures-Kontrakte können dazu verwendet werden, das Engagement eines Fonds am Wertpapiermarkt zu steuern. Durch den Kauf von Futures erhöht sich in der Regel das Engagement eines Fonds in dem zugrunde liegenden Instrument, während es sich durch den Verkauf von Futures in der Regel verringert. Beim Abschluss eines Futures-Kontraktes muss ein Fonds bei seinem Broker eine bestimmte Summe in bar oder in Form von US-Staatsanleihen hinterlegen – die sogenannte Einschussmarge oder Initial Margin –, die den entsprechenden Anforderungen des Brokers oder der Börse genügen muss. Die Gesellschaft und der Broker vereinbaren, einen Betrag in Höhe der täglichen Wertschwankungen des Futures-Kontraktes auszutauschen (die „Futures-Margin“).

Gewinne oder Verluste werden ausgewiesen, gelten aber nicht als realisiert, bis die Kontrakte auslaufen oder glattgestellt werden. Futures-Kontrakte bergen – in unterschiedlichem Ausmaß – das Risiko eines Verlusts, der über die in der Bilanz angegebene Nachschussmarge (Variation Margin) hinausgehen kann.

Verluste können dadurch entstehen, dass sich der Wert des zugrunde liegenden Instruments ändert, der Sekundärmarkt für die Kontrakte illiquide ist oder die Kontrahenten ihren Verpflichtungen im Rahmen der Kontraktbedingungen nicht nachkommen.

Futures-Kontrakte werden zum Bewertungszeitpunkt am Handelstag zum letzten gehandelten Kurs bewertet, der für solche Instrumente an solchen Märkten festgestellt wird.

Wenn verbriefte Sicherheiten an den Broker verpfändet wurden, ist das entsprechenden Wertpapier im Anlageportfolio durch einen Vermerk gekennzeichnet.

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

h) Swap-Kontrakte

Die Gesellschaft kann Credit Default Swaps, Zinsswaps und Total Return Swaps eingehen. Die Gesellschaft kann diese Swapgeschäfte zu Anlagezwecken und für ein effizientes Portfoliomanagement eingehen. Ein Swapgeschäft beinhaltet eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien über den Austausch unterschiedlicher Zahlungsströme auf der Grundlage eines festgelegten oder „fiktiven" Betrags. Bei den im Rahmen einer bestimmten Transaktion ausgetauschten Zahlungsströmen kann es sich unter anderem um Zahlungen handeln, die den Gegenwert von Zinsen auf einen Kapitalbetrag darstellen, um Zahlungen, die den Käufer für Verluste bei einem ausgefallenen Wertpapier oder Wertpapierkorb entschädigen würden, oder um Zahlungen, die die Wertentwicklung einer oder mehrerer bestimmter Währungen, Wertpapiere oder Indizes widerspiegeln.

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus offenen Swap-Kontrakten und erste Vorauszahlungen, die bei Abschluss eines Swap-Kontrakts erhalten oder geleistet wurden, sind im beizulegenden Zeitwert des Swap in der Bilanz enthalten. Veränderungen des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts aus Swap-Kontrakten zum Ende des Berichtszeitraums werden in der Gesamterfolgsrechnung ausgewiesen. Bei Beendigung eines Swaps erhaltene oder geleistete Liquidierungszahlungen werden in der Gesamterfolgsrechnung als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Zinsaufwendungen für Anlagen in Swap-Kontrakten sind im „Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten" in der Gesamterfolgsrechnung enthalten. Möglicherweise müssen im Rahmen der Swap-Vereinbarung Sicherheiten in Form von Barmitteln oder Wertpapieren bei der Verwahrstelle oder dem Broker hinterlegt werden.

i) Erträge und Aufwendungen

Zinserträge und -aufwendungen werden in der Gesamterfolgsrechnung für alle Schuldinstrumente unter Anwendung der Effektivzinsmethode verbucht. Die Effektivzinsmethode ist eine Methode zur Berechnung der fortgeführten Anschaffungskosten eines finanziellen Vermögenswertes oder einer finanziellen Verbindlichkeit und zur Allokation von Zinserträgen oder Zinsaufwendungen auf die jeweiligen Perioden. Der Effektivzinssatz ist derjenige Kalkulationszinssatz, mit dem die geschätzten künftigen Ein- und Auszahlungen über die erwartete Laufzeit des Finanzinstruments oder gegebenenfalls eine kürzere Periode exakt auf den Nettobuchwert des finanziellen Vermögenswertes oder der finanziellen Verbindlichkeit abgezinst werden.

Bei der Ermittlung des Effektivzinssatzes berücksichtigt der Fonds zur Schätzung der Cashflows alle vertraglichen Bedingungen des Finanzinstruments, nicht jedoch künftige Kreditausfälle.

Dividenden werden in der Gesamterfolgsrechnung zu jenem Zeitpunkt verbucht, zu dem die jeweiligen Wertpapiere „ex-Dividende" notiert werden. Erträge werden vor Abzug von nicht rückforderbaren/uneinbringlichen Quellensteuern und nach Abzug von Steuergutschriften verbucht. Die Quellensteuer wird in der Gesamterfolgsrechnung getrennt ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagetransaktionen werden nach dem First-in-First-Out-Verfahren berechnet.

Realisierte Gewinne und Verluste aus Anlagetransaktionen in Schuldinstrumenten werden zu fortgeführten Anschaffungskosten auf der Basis des Effektivzinssatzes berechnet.

j) Bargeld und bargeldähnliche Instrumente

Unter Bargeld und bargeldähnliche Instrumente fallen Kassenbestände, Sichteinlagen bei Banken, sonstige kurzfristige hochliquide Anlagen mit einer ursprünglichen Laufzeit von drei Monaten oder weniger und Kontokorrentkredite.

Alle liquiden Mittel werden bei Brown Brothers Harriman & Co. oder bei einem von der Gesellschaft genehmigten Drittinstitut als täglich fällige Einlagen oder aber direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. Alle Sichteinlagen bei Banken werden der .Verwahrstelle am Folgetag zurückgezahlt Erläuterung 5 enthält eine Aufstellung der Finanzinstitute, bei denen zum Geschäftsjahresende Barbestände unterhalten wurden.

Als Reaktion auf die Veröffentlichung des Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) Investor Money Regulations 2015 für Fondsdienstleister in der jeweils gültigen Fassung („Investor Money Regulations" oder „IMR") (mit Wirkung ab dem 1. Juli 2016) von der CBI im März 2015, hat der Portfolioverwalter gemeinsam mit der Verwaltungsstelle eine Überprüfung durchgeführt, auf welche Weise Zeichnungs-, Ausschüttungs- und Rücknahmegelder an die und von der Gesellschaft gezahlt werden. Infolge dieser Überprüfung wird die Zahlung von Zeichnungs- und Rücknahmegeldern mit Wirkung vom 1. Juli 2016 im Namen der Gesellschaft über ein Umbrella Cash Collection Account abgewickelt.

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

k) Fremdwährungstransaktionen

Gemäß IAS 21 werden die in den Rechnungsabschlüssen der einzelnen Fonds aufgeführten Positionen in der Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds (funktionale Währung) ausgewiesen. Aufgrund der Anlagestrategie der einzelnen Fonds gilt als funktionale Währung der US-Dollar (USD).

Die einzelnen Fonds haben die funktionale Währung auch als Darstellungswährung übernommen. Aufwands- und Ertragstransaktionen werden zu dem zum Zeitpunkt der Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung des jeweiligen Fonds umgerechnet. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Wechselkurs in USD umgerechnet.

Erlöse aus Zeichnungen und Zahlungen aufgrund von Rücknahmen, die nicht auf die funktionale Währung lauten, werden zu dem zum Zeitpunkt der Transaktion geltenden Wechselkurs in die funktionale Währung umgerechnet.

Für die einzelnen Fonds gilt:

(i) Währungsgewinne und -verluste können entstehen, wenn eine Differenz zwischen den in den Büchern der Fonds verzeichneten ausländischen Dividenden und Zinsen und dem Gegenwert der tatsächlich erhaltenen oder gezahlten Beträge in der funktionalen Währung des Fonds besteht. Diese Gewinne oder Verluste werden entsprechend unter den Dividenden- oder Anleihezinserträgen in der Gesamterfolgsrechnung des jeweiligen Fonds verbucht.

(ii) Realisierte Währungsgewinne und -verluste aus Wertpapierkäufen und -verkäufen werden ebenfalls in der Gesamterfolgsrechnung des Fonds verbucht.

(iii) Die Veränderung der nicht realisierten Währungsgewinne oder -verluste auf Wertpapiere, die sich zum Geschäftsjahresende im Portfolio befinden, wird in der Gesamterfolgsrechnung des Fonds ausgewiesen.

(iv) Monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die nicht auf die funktionale Währung des Fonds lauten, werden zu dem zum Geschäftsschluss am jeweiligen Berichtsstichtag geltenden Kurs umgerechnet, und Wechselkursdifferenzen werden in der Gesamterfolgsrechnung des Fonds ausgewiesen.

Der Jahresabschluss wird in USD und EUR dargestellt. Zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurden folgende Wechselkurse benutzt, um die auf andere Währungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten im Portfolio in USD umzurechnen:

		31. Dezember 2023	31. Dezember 2022		31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
1 USD =	AUD	1,4655	1,4994	KRW	1.287,9000	1.264,5000
	BRL	4,8576	5,2798	MXN	16,9345	19,4873
	CAD	1,3186	1,3550	MYR	4,5950	4,4050
	CHF	0,8417	0,9252	NOK	10,1557	9,8510
	CLP	873,2850	851,9500	NZD	1,5794	1,5812
	CNH	7,1206	6,9189	PEN	n. z.	3,8135
	CNY	7,0922	6,9517	PHP	n. z.	55,7275
	COP	3.874,0000	4.848,8850	PLN	3,9323	4,3863
	DKK	6,7484	6,9679	RUB	89,4000	73,0000
	EGP	30,9250	24,7550	SAR	3,7500	3,7580
	EUR	0,9053	0,9370	SEK	10,0779	10,4195
	GBP	0,7844	0,8313	SGD	1,3191	1,3412
	HKD	7,8086	7,8050	THB	34,1325	34,6350
	HUF	346,0056	n. z.	TRY	29,5340	18,7195
	IDR	15.397,0000	15.567,5000	TWD	30,6905	30,7355
	ILS	3,6009	3,5285	UYU	39,0400	39,7650
	INR	83,2138	82,7300	ZAR	18,2875	17,0150
	JPY	140,9800	131,9450			

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

k) Fremdwährungstransaktionen (Fortsetzung)

		31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
1 EUR =	AUD	n. z.	1,5738
	CHF	0,9297	n. z.
	USD	1,1047	1,0673

l) Ertragsausgleich

Die Gesellschaft verwendet die Bilanzierungsmethode des Ertragsausgleichs, wobei derjenige Teil des Zeichnungs- und Rücknahmepreises von Anteilen der Fonds, der den zum Transaktionszeitpunkt im Anteilspreis enthaltenen Erträgen entspricht, bei einer entsprechenden Zeichnung oder Rücknahme jeweils dem Ertrag verbucht oder belastet wird.

m) Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile

Die Fonds begeben rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile, die auf Wunsch des Anteilinhaber zurückgenommen und den Finanzpassiva zugerechnet werden.

Die rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile können an jedem beliebigen Handelstag gegen bar in Höhe des entsprechenden Anteils am Nettovermögen der Gesellschaft zurückgegeben werden. Die gewinnberechtigten Anteile werden zu dem am Bilanzstichtag geltenden Rücknahmepreis ausgewiesen, wenn der Anteilinhaber sein Recht ausgeübt hat, die Anteile an die Gesellschaft zurückzugeben.

Die Ausgabe und Rücknahme von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen erfolgt auf Wunsch des Anteilinhabers. Die Preise richten sich nach dem Nettoinventarwert je Fondsanteil bei Ausgabe bzw. Rücknahme. Der Nettoinventarwert je Anteil eines Fonds wird berechnet, indem das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen durch die Gesamtanzahl der umlaufenden rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile dividiert wird.

n) Saldieren von Finanzinstrumenten

Sofern ein vollstreckbares Recht besteht, die ausgewiesenen Beträge miteinander zu verrechnen, und beabsichtigt wird, den Ausgleich auf Nettobasis herbeizuführen oder gleichzeitig mit der Realisierung des Vermögenswerts die entsprechende Verbindlichkeit abzulösen, werden die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen.

o) Ausschüttungen an Inhaber von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen

Die Ausschüttungen an Inhaber der rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteile werden in der Gesamterfolgsrechnung als Finanzaufwand ausgewiesen.

p) Kauf/Verkauf von noch nicht abgerechneten Wertpapieren

Unter Verbindlichkeiten/Forderungen gegenüber Maklern fallen Verbindlichkeiten aus Käufen und Forderungen aus Verkäufen von Wertpapieren, die zum Geschäftsjahresende vereinbart, aber noch nicht geliefert waren.

q) Transaktionskosten

Die Transaktionskosten sind die Kosten, die bei Erwerb, Emission oder Veräußerung von finanziellen Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten entstehen. Sie umfassen an Broker und Händler gezahlte Gebühren und Provisionen, Gebühren von Aufsichtsbehörden und Börsen sowie Erwerbsteuern und Abgaben. Nicht zu den Transaktionskosten zählen hingegen Agios und Disagios von Verbindlichkeiten, Finanzierungskosten oder interne Verwaltungs- oder Bestandskosten. Für die Finanzberichterstattung werden diese Kosten im Moment ihres Entstehens in der Gesamterfolgsrechnung als Aufwendungen erfasst.

1. WICHTIGE RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE (Fortsetzung)

r) Übertragungen zwischen den einzelnen Stufen der Fair-Value-Hierarchie

Es wird davon ausgegangen, dass die Übertragungen zwischen den einzelnen Stufen der Fair-Value-Hierarchie zu Beginn des Berichtszeitraums vorgenommen wurden.

s) Swing-Pricing

Die Fonds können anstelle des Einheitspreis-Mechanismus einen einheitlichen Swing-Pricing-Mechanismus gemäß dem maßgeblichen Nachtrag zum Prospekt nutzen. Während des zum 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahres waren nur der Loomis Sayles High Income Fund, der Loomis Sayles Euro High Yield Fund, der Loomis Sayles Euro Credit Fund und der Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund in der Lage, einen einheitlichen Swing-Pricing-Mechanismus gemäß dem maßgeblichen Nachtrag zum Prospekt zu nutzen.

Während des zum 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahres haben nur der Loomis Sayles High Income Fund, der Loomis Sayles Euro High Yield Fund, der Loomis Sayles Euro Credit Fund und der Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund Swing Price-Anpassungen vorgenommen. Während des zum 31. Dezember 2022 abgelaufenen Geschäftsjahres haben nur der Loomis Sayles High Income Fund, der Loomis Sayles Euro High Yield Fund, der Loomis Sayles Euro Credit Fund und der Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund Swing Price-Anpassungen vorgenommen.

Während des zum 31. Dezember 2023 abgelaufenen Geschäftsjahres wurden bei keinem anderen Fonds Swing-Pricing-Anpassungen in Bezug auf den Nettoinventarwert je Anteil vorgenommen (im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022: keine).

Die Swing-Pricing-Methode ist ein Vorgang, bei der der Preis an einem bestimmten Handelstag angepasst werden kann, um im Fall von umfangreichen Zeichnungen, Rücknahmen bzw. Umtauschvorgängen eines Fonds an einem Handelstag die Verwässerungseffekte zu berücksichtigen und die Interessen der Anteilinhaber zu schützen. Dies bedeutet: Wenn die gesamten Transaktionen mit Anteilen eines Fonds an einem bestimmten Handelstag einen vom Verwaltungsrat festgelegten Mindestbetrag überschreiten, kann der Nettoinventarwert um einen Betrag in Höhe von maximal 2 % des entsprechenden Nettoinventarwerts angepasst werden, um die geschätzten steuerlichen Abgaben und Handelskosten zu berücksichtigen, die dem Fonds möglicherweise entstehen, und der geschätzten Handelsspanne der Vermögenswerte Rechnung zu tragen, in die der Fonds investiert bzw. die er veräußert. In diesem Fall ist der offizielle, veröffentlichte Nettoinventarwert je Anteil der Nettoinventarwert, auf den der Swing Price angewendet wurde. Wenn eine solche Anpassung vorgenommen wird, führt dies in der Regel bei umfangreichen Mittelzuflüssen in den Fonds zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts je Anteil, während sich bei umfangreichen Mittelabflüssen der Nettoinventarwert je Anteil gewöhnlich verringert.

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
2. ANLAGEERTRÄGE								
Anleiheertrag	26.253.009	440.269	1.229.666	558.454	1.343.964	3.782.199	20.300.258	56.568.694
Erträge aus Einlagezinsen	340.747	6.583	36.837	233.854	30.978	52.883	232.262	967.226
Dividendenertrag	1.342.317	19.458	–	249.421	–	–	–	1.611.196
Ertragsausgleich	–	(24.912)	(54.238)	–	–	–	–	(79.150)
Sonstige Erträge	(184)	–	–	599	–	4.219	5.053	10.658
	27.935.889	441.398	1.212.265	1.042.328	1.374.942	3.839.301	20.537.573	59.078.624

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
ANLAGEERTRÄGE								
Anleiheertrag	24.378.611	640.309	1.741.630	538.719	834.753	1.525.918	5.747.602	35.952.823
Erträge aus Einlagezinsen	177.327	3.660	14.424	72.797	(2.240)	(10.329)	(15.996)	237.722
Dividendenertrag	1.769.305	33.518	–	207.582	–	–	–	2.010.405
Ertragsausgleich	(721.405)	(16.032)	(11.060)	–	–	–	–	(748.497)
Sonstige Erträge	9.752	–	–	2.128	1.688	–	–	13.680
	25.613.590	661.455	1.744.994	821.226	834.201	1.515.589	5.731.606	37.466.133

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2023	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
3. OPERATIVE AUFWENDUNGEN									
Portfolioverwaltungsgebühren[1]	9	6.254.058	87.846	295.326	2.078	98.374	715.823	3.104.865	10.968.500
Sonstige Aufwendungen	9	239.808	18.631	33.109	111.399	33.460	54.428	155.418	671.715
Gebühren und Aufwendungen für Expertenleistungen		195.109	13.829	14.342	29.294	6.569	29.892	150.198	458.767
Verwaltungsgebühren	9	29.980	13.381	5.183	3.063	4.963	7.346	13.179	79.762
Verwahrstellengebühr	9	218.622	6.194	(27.713)	(92.209)	19.095	59.598	223.341	438.536
Prüfungsgebühren	10	28.050	28.050	29.350	28.050	26.569	26.569	26.569	201.548
Vergütung des Verwaltungsrats		12.545	125	(83)	571	870	3.567	22.449	42.858
		6.978.172	168.056	349.514	82.246	189.900	897.223	3.696.019	12.861.686
Rückvergütungen vom Portfolioverwalter	9	(206.986)	(63.933)	(11.820)	–	(74.905)	(560.800)	(2.181.970)	(3.395.284)
		6.771.186	104.123	337.694	82.246	114.995	336.423	1.514.049	9.466.402

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
OPERATIVE AUFWENDUNGEN									
Portfolioverwaltungsgebühren[1]	9	7.427.276	133.628	523.200	11.380	91.342	358.404	1.776.621	10.471.574
Sonstige Aufwendungen	9	306.181	24.687	73.326	80.500	36.560	60.355	157.828	756.569
Gebühren und Aufwendungen für Expertenleistungen		333.779	12.308	29.700	30.796	9.502	35.289	121.845	584.425
Verwaltungsgebühren	9	112.136	109.947	44.926	20.283	36.716	32.042	15.811	377.548
Verwahrstellengebühr	9	38.135	11.567	31.298	122.529	16.312	22.796	14.418	260.655
Prüfungsgebühren	10	27.997	27.160	27.159	27.160	24.942	24.942	24.942	189.334
Vergütung des Verwaltungsrats		60.923	978	6.115	2.584	2.719	10.127	36.087	122.824
		8.306.427	320.275	735.724	295.232	218.093	543.955	2.147.552	12.762.929
Rückvergütungen vom Portfolioverwalter	9	(247.188)	(161.817)	(191.833)	(168.969)	(115.676)	(257.823)	(1.303.206)	(2.559.271)
		8.059.239	158.458	543.891	126.263	102.417	286.132	844.346	10.203.658

[1] Die Vertriebsgebühren für die Anteilsklasse CT sind in den Portfolioverwaltungsgebühren enthalten und beliefen sich auf USD 1.013 (31. Dezember 2022: USD 34.503) und USD 0 (31. Dezember 2022: USD 3.367) für den Loomis Sayles Multisector Income Fund und den Loomis Sayles High Income Fund.

ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
4. ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN								
Anleihen	514.013.614	6.450.801	15.443.164	11.122.279	31.101.256	121.332.450	841.442.328	1.644.915.019
Aktien	5.825.724	67.232	–	10.642.680	–	–	–	16.535.636
Forwards	1.108.793	43.193	2.536	557.685	139	(15.595)	–	1.695.134
Futures	3.363.365	–	4.548	(335.876)	13.675	59.580	(11.665)	3.100.072
Swaps	–	–	–	396.937	–	–	–	396.937
Anlagefonds	11.489.676	153.191	–	–	–	–	–	11.642.867
	535.801.172	6.714.417	15.450.248	22.383.705	31.115.070	121.376.435	841.430.663	1.678.285.665
GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2023								
NETTOGEWINN AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN								
Anleihen	21.021.762	366.574	1.235.430	309.794	1.970.122	6.626.472	35.158.984	71.268.159
Aktien	(859.078)	14.971	(832)	1.726.784	–	–	–	881.845
Forwards	294.974	24.403	197.600	241.522	113	(2.562)	(4.457)	750.870
Futures	(2.329.608)	–	(104.247)	(14.469)	25.050	91.540	39.870	(2.275.490)
Swaps	–	–	–	451.241	–	22.407	68.958	552.167
Anlagefonds	–	(21.341)	–	–	–	–	–	(21.341)
	18.128.050	384.607	1.327.951	2.714.872	1.995.285	6.737.857	35.263.355	71.156.210

ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
4. ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN								
Anleihen	558.731.897	8.159.155	57.217.806	8.372.945	25.984.449	99.548.918	388.538.295	1.181.124.784
Aktien	12.511.407	103.478	–	11.779.840	–	–	–	24.394.725
Forwards	8.971	(51)	(40.558)	39.446	(4)	–	–	7.804
Futures	(494.497)	–	(1.286)	12.511	(25.312)	(326.233)	(792.558)	(1.704.316)
Swaps	–	–	–	15.746	–	–	(3.149)	12.385
Anlagefonds	12.322.566	244.197	–	–	–	–	–	12.566.763
	583.080.344	8.506.779	57.175.962	20.220.488	25.959.133	99.222.685	387.742.588	1.216.402.145
GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022								
NETTOGEWINN AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN								
Anleihen	(121.110.252)	(2.501.640)	(13.406.564)	(1.283.065)	(3.787.240)	(15.724.791)	(41.626.824)	(203.551.964)
Aktien	(8.077.982)	(80.359)	4.778	(1.025.378)	–	–	–	(9.178.941)
Forwards	(6.730.448)	(178.052)	(2.681.643)	(3.386.785)	546	1	–	(12.976.344)
Futures	9.861.237	–	(79.645)	1.402.734	(74.897)	(1.277.208)	(2.880.218)	6.667.379
Swaps	–	–	–	410.496	–	9.922	119.766	548.906
Rechte	–	–	–	14	–	–	–	14
Anlagefonds	–	–	–	(90.768)	–	–	–	(90.768)
	(126.057.445)	(2.760.051)	(16.163.074)	(3.972.752)	(3.861.591)	(16.992.076)	(44.387.276)	(218.581.718)

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
4. NETTOGEWINN AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN								
Realisierter Gewinn/(Verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	(40.775.544)	(428.136)	(6.996.158)	129.375	(60.921)	(2.783.041)	(7.824.758)	(59.855.665)
Veränderung des nicht realisierten Gewinns aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	58.903.594	812.743	8.324.109	2.585.497	2.056.206	9.520.898	43.088.113	131.011.875
	18.128.050	384.607	1.327.951	2.714.872	1.995.285	6.737.857	35.263.355	71.156.210

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
NETTOGEWINN AUS ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETEN FINANZIELLEN VERMÖGENSWERTEN UND VERBINDLICHKEITEN								
Realisierter Verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	(36.951.397)	(856.875)	(6.980.572)	(2.309.620)	(2.620.756)	(11.632.496)	(26.763.368)	(90.873.451)
Veränderung des nicht realisierten Verlusts aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten	(89.106.048)	(1.903.176)	(9.182.502)	(1.663.132)	(1.240.835)	(5.359.580)	(17.623.908)	(127.708.267)
	(126.057.445)	(2.760.051)	(16.163.074)	(3.972.752)	(3.861.591)	(16.992.076)	(44.387.276)	(218.581.718)

ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
5. BANKGUTHABEN								
Brown Brothers Harriman & Co.	239.088	451	(213.147)	297.196	3.142	3.635	17.965	350.919
Australia and New Zealand Banking Group, London	–	–	989	–	–	–	–	989
BNP Paribas, Paris	–	–	6.486	6.155	–	–	–	12.641
DNB ASA, Oslo, Norwegen	–	–	2.324	–	–	–	–	2.324
DBS Bank Limited	–	–	–	1.726.923	–	–	–	1.726.923
HSBC, Hongkong	–	–	3.788	32.532	–	–	–	36.320
HSBC, London, England	–	–	–	21.809	–	–	–	21.809
JP Morgan	10.345.926	–	417.034	–	–	–	–	10.762.960
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	5.682	43.312	–	–	–	48.994
Skandinaviska Enskilda Banken AB	–	–	29.524	23.529	–	–	–	53.053
Standard Chartered Bank, Johannesburg	–	–	1.982	64.450	–	–	–	66.432
Sumitomo Mitsui Banking Corporation	27	91.750	45.234	294.392	1.336.205	1.526.580	5.884.683	10.094.294
	10.585.041	92.201	299.896	2.510.298	1.339.347	1.530.215	5.902.648	23.177.658

	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FONDS USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FONDS EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FONDS EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
ZUM 31. Dezember 2022								
5. BANKGUTHABEN								
Brown Brothers Harriman & Co.	(103.633)	463	262.794	204.185	536	1.226	4.863	370.880
Australia and New Zealand Banking Group, London	–	–	15.212	54.797	–	–	–	70.009
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, Madrid	5.891.542	–	897.591	1.312.941	–	–	–	8.102.074
BNP Paribas, Paris	–	–	28.231	–	–	–	–	28.231
Credit Suisse Group AG	–	–	8.888	341	–	–	–	9.229
HSBC, Hongkong	–	–	7.497	35.018	–	–	–	42.515
JP Morgan	–	242.492	–	–	–	–	–	242.492
MUFG Bank, Tokio	–	–	–	93.879	–	–	–	93.879
Royal Bank of Canada, Toronto	–	–	11.926	82.032	–	–	–	93.958
Skandinaviska Enskilda Banken AB	–	–	4.772	61.101	–	–	–	65.873
Standard Chartered Bank, Johannesburg	–	–	2.120	71.499	–	–	–	73.619
Sumitomo Mitsui Banking Corporation	–	–	83.051	97.118	1.154.519	1.175.855	5.124.133	8.135.991
	5.787.909	242.955	1.322.082	2.012.911	1.155.055	1.177.081	5.128.996	17.328.750

ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FONDS USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FONDS EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FONDS EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
5(a). AN BROKER ZAHLBARE EINLAGEN FÜR SICHERHEITEN FÜR DERIVATE								
Künftige Bareinschüsse								
JP Morgan	(3.374.858)	–	206.185	2.769.216	28.629	162.260	605.842	480.652
Morgan Stanley	–	–	–	144.740	–	–	–	144.740
Barsicherheit								
Morgan Stanley	–	–	–	350.000	–	–	–	350.000
	(3.374.858)	–	206.185	3.263.956	28.629	162.260	605.842	975.392

ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FONDS USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FONDS EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FONDS EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
AN BROKER ZAHLBARE EINLAGEN FÜR SICHERHEITEN FÜR DERIVATE								
Künftige Bareinschüsse								
Citibank	–	–	–	20.000	–	–	–	20.000
JP Morgan	385.360	–	(1.198)	171.853	23.164	298.463	716.075	1.663.503
Morgan Stanley	–	–	–	539.407	–	–	–	539.407
Barsicherheit								
Bank of America	–	–	(260.000)	–	–	–	–	(260.000)
Citibank	–	–	–	30.000	–	–	–	30.000
JP Morgan	–	–	210.000	1.966.000	45.000	250.000	670.000	3.205.896
Morgan Stanley	–	–	–	350.000	–	–	–	350.000
UBS	–	–	10.000	–	–	–	–	10.000
	385.360	–	(41.198)	3.077.260	68.164	548.463	1.386.075	5.558.806

ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
6. DEBITOREN								
Zeichnung von Anteilen, noch nicht abgerechnet	1.470.095	–	36.005	–	26.759	630.961	2.357.588	4.836.960
Forderungen aus Anleiheerträgen	7.436.316	104.658	157.886	64.234	443.664	1.505.638	10.074.252	21.044.913
Veräußerung von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	110.000	–	–	(3.349)	–	–	–	106.651
Sonstige Debitoren	36.114	2.700	7.588	36.121	24.439	114.500	439.411	721.397
	9.052.525	**107.358**	**201.479**	**97.006**	**494.862**	**2.251.099**	**12.871.251**	**26.709.921**

ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
DEBITOREN								
Zeichnung von Anteilen, noch nicht abgerechnet	1.038.772	–	86.761	–	805	3.983	747.870	1.928.807
Forderungen aus Anleiheerträgen	5.469.369	133.271	474.573	45.590	392.019	881.912	3.594.856	11.319.016
Veräußerung von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	–	–	–	1.248.686	–	–	–	1.248.686
Sonstige Debitoren	(2.077)	(47.095)	(85.666)	(118.483)	(652)	21.949	52.398	(174.670)
	6.506.064	**86.176**	**475.668**	**1.175.793**	**392.172**	**907.844**	**4.395.124**	**14.321.839**

ZUM 31. Dezember 2023	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
7. KREDITOREN									
Rücknahme von Anteilen, noch nicht abgerechnet		1.708.049	35.930	43.640	–	1.790	267.787	1.344.725	3.570.858
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet		200	5.047	–	–	–	–	826.943	918.730
Zu zahlende Zinsen auf Anlagen		–	–	–	835	–	–	–	835
Sonstige Verbindlichkeiten		152.995	43.275	52.262	90.713	75.953	94.363	186.586	733.497
Verbindlichkeiten aus Gebühren an den Portfolioverwalter	9	992.685	13.937	36.069	80	18.606	151.896	704.086	2.008.884
Zu zahlende Depotgebühren	9	32.590	10.820	7.040	4.721	7.140	11.963	36.286	116.356
		2.886.519	**109.009**	**139.011**	**96.349**	**103.489**	**526.009**	**3.098.626**	**7.349.160**

ZUM 31. Dezember 2022	Erläuterungen	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND EUR	GESAMT USD
KREDITOREN									
Rücknahme von Anteilen, noch nicht abgerechnet		2.108.063	3.689	7.514	–	9.057	14.688	847.182	3.048.763
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet		153	64.509	–	1.196.875	–	–	–	1.261.537
Zu zahlende Zinsen auf Anlagen		–	–	–	22.370	–	–	–	22.370
Sonstige Verbindlichkeiten		266.451	54.418	87.515	114.541	86.514	114.328	178.711	928.003
Verbindlichkeiten aus Gebühren an den Portfolioverwalter	9	573.246	8.897	40.599	401	7.322	42.376	195.938	885.298
Zu zahlende Verwaltungsgebühren	9	23.614	70.891	40.752	15.031	22.186	14.357	–	189.288
Zu zahlende Depotgebühren	9	1.868	6.371	23.878	92.135	7.459	7.554	–	140.275
		2.973.395	**208.775**	**200.258**	**1.441.353**	**132.538**	**193.303**	**1.221.831**	**6.475.534**

8. KAPITAL

Genehmigt

Das genehmigte Kapital der Gesellschaft beläuft sich auf USD 70.000, verteilt auf 70.000 Zeichnungsanteile mit einem Nennwert von je USD 1 und 5.000.000.000 nennwertlose Anteile, die als unklassifizierte Anteile bezeichnet werden. Die unklassifizierten Anteile können als rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile emittiert werden.

Um das nach irischem Recht vorgeschriebene Mindestkapital bei der Gründung bereitzustellen, hat der Portfolioverwalter 69.993 Zeichnungsanteile zum Nennwert gezeichnet und vollständig in bar einbezahlt. Außerdem wurden weitere sieben Zeichnungsanteile zum Nennwert an Bevollmächtigte ausgegeben und vollständig in bar einbezahlt. Der Fonds hat seitdem alle 69.993 Zeichnungsanteile des Portfolioverwalters zum Nennwert zurückgenommen, und es werden keine weiteren Zeichnungsanteile ausgegeben.

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse C/A (USD)	780.909	940	–	(193.418)	588.431
Anteilsklasse C/D (USD)	463.361	–	5.845	(108.472)	360.734
Anteilsklasse CT/A (USD)	4.267	32.881	–	(8.917)	28.231
Anteilsklasse CT/DG (USD)	1.018	–	42	–	1.060
Anteilsklasse CT/DM (USD)	10.130	243.679	–	(32.638)	221.171
Anteilsklasse F/A (USD)	82.155	–	–	(22.955)	59.200
Anteilsklasse F/DM (USD)	53.123	–	2.026	–	55.149
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	375.733	61.702	–	(217.419)	220.016
Anteilsklasse H-I/D (EUR)	44.975	45.416	–	(2.250)	88.141
Anteilsklasse H-I/D (GBP)	152.589	–	–	(15.105)	137.484
Anteilsklasse H-N/A (CHF)	750	–	–	–	750
Anteilsklasse H-N/A (EUR)	214.822	451	–	(44)	215.229
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	2.450	–	–	(2.450)	–
Anteilsklasse H-N1/A (EUR)	273.009	444.713	–	(250.331)	467.391
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	2.794.167	74.164	–	(1.455.873)	1.412.458
Anteilsklasse H-R/A (SGD)	2.554.156	637.282	–	(598.289)	2.593.149
Anteilsklasse H-R/D (SGD)	549.825	2.788	4.448	(106.600)	450.461
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	99.258	4.608	–	(6.620)	97.246
Anteilsklasse H-S/D (EUR)	76.550	–	–	(4.050)	72.500
Anteilsklasse I/A (EUR)	88.171	3.072	–	(21.541)	69.702
Anteilsklasse I/A (USD)	6.759.896	894.071	–	(3.601.808)	4.052.159
Anteilsklasse I/D (GBP)	9.990	–	–	–	9.990
Anteilsklasse I/D (USD)	3.081.784	1.488.764	52.619	(1.220.815)	3.402.352
Anteilsklasse I/DG (USD)	1.018	–	42	–	1.060
Anteilsklasse N/A (EUR)	–	475.924	–	(69.932)	405.992
Anteilsklasse N/A (USD)	4.882	–	–	(4.882)	–
Anteilsklasse N/DM (USD)	47.510	–	–	(47.510)	–
Anteilsklasse N1/A (USD)	848.598	209.331	–	(203.570)	854.359
Anteilsklasse N1/D (USD)	497.279	92.690	1.101	(71.261)	519.809
Anteilsklasse R/A (EUR)	564.229	1.136.960	–	(319.865)	1.381.324
Anteilsklasse R/A (SGD)	71.101	1.377	–	(8.485)	63.993
Anteilsklasse R/A (USD)	5.639.617	217.437	–	(1.364.532)	4.492.522
Anteilsklasse R/D (EUR)	44.529	–	1.481	–	46.010
Anteilsklasse R/D (GBP)	110.742	3.281	–	(11.782)	102.241
Anteilsklasse R/D (SGD)	239.943	2.988	465	(21.434)	221.962
Anteilsklasse R/D (USD)	3.611.239	87.413	34.673	(646.210)	3.087.115
Anteilsklasse R/DG (USD)	1.018	4.746	36	(1.400)	4.400
Anteilsklasse R/DM (USD)	2.077.008	178.755	2.043	(359.073)	1.898.733
Anteilsklasse RE/A (EUR)	269.448	1.676	–	(74.459)	196.665
Anteilsklasse RE/A (USD)	6.044.123	434.775	–	(1.008.561)	5.470.337
Anteilsklasse RE/D (USD)	97	–	–	–	97
Anteilsklasse RE/DM (USD)	106	–	–	(9)	97
Anteilsklasse S/A (USD)	3.886.871	177.814	–	(256.217)	3.808.468
Anteilsklasse S/D (GBP)	678	–	–	–	678
Anteilsklasse S/D (USD)	38.300	–	–	–	38.300

Erläuterungen zum Jahresabschluss zum 31. Dezember 2023 (Fortsetzung)

8. KAPITAL (Fortsetzung)

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	80.106	–	–	(852)	79.254
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	422	–	9	–	431
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	1.161	–	–	(1.161)	–
Anteilsklasse I/A (EUR)	68.640	–	–	(60.790)	7.850
Anteilsklasse I/A (USD)	141	–	–	–	141
Anteilsklasse I/D (USD)	294.030	–	14.181	(128.149)	180.062
Anteilsklasse N/DM (USD)	434	–	–	(434)	–
Anteilsklasse R/A (EUR)	64.306	765	–	(9.745)	55.326
Anteilsklasse R/A (USD)	4.280	–	–	–	4.280
Anteilsklasse R/D (USD)	255.873	6.511	1.170	(29.699)	233.855
Anteilsklasse R/DM (USD)	211.048	–	–	(39.159)	171.889
Anteilsklasse S/A (USD)	5.500	–	–	(2.400)	3.100

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse C/A (USD)	12.930	–	–	–	12.930
Anteilsklasse H-F/A (GBP)	–	300	–	–	300
Anteilsklasse H-F/D (GBP)	–	300	–	–	300
Anteilsklasse H-I/A (SGD)	152.582	40.722	–	(193.304)	–
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	388	–	5	–	393
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	43.286	8.548	–	(10.626)	41.208
Anteilsklasse H-S/D (GBP)	2.475.360	–	–	(2.475.360)	–
Anteilsklasse I/A (USD)	2.228.246	575.775	–	(2.047.996)	756.025
Anteilsklasse I/D (USD)	69.367	–	1.301	(14.059)	56.609
Anteilsklasse N/A (EUR)	6	–	–	–	6
Anteilsklasse N1/A (USD)	14.888	252	–	(15.140)	–
Anteilsklasse R/A (EUR)	193.934	5.781	–	(38.287)	161.428
Anteilsklasse R/A (USD)	28.898	284	–	(162)	29.020
Anteilsklasse R/D (GBP)	13.382	2.018	–	(971)	14.429
Anteilsklasse R/D (USD)	163.571	11.730	1.332	(59.461)	117.172

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	49.122	–	–	(46.122)	3.000
Anteilsklasse H-Q/A (EUR)	2.257.517	–	–	–	2.257.517
Anteilsklasse I/A (USD)	287	–	–	–	287
Anteilsklasse R/A (USD)	287	–	–	–	287

8. KAPITAL (Fortsetzung)

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (CHF)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse H-N/A (CHF)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse H-R/A (CHF)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse I/A (EUR)	10	52.000	–	–	52.010
Anteilsklasse N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse Q/A (EUR)	1.762.817	–	–	(51.020)	1.711.797
Anteilsklasse R/A (EUR)	205	–	–	–	205
Anteilsklasse RE/A (EUR)	300	1.608	–	–	1.908
Anteilsklasse S/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse S2/A (EUR)	1.266.362	516.451	–	(289.319)	1.493.494

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (USD)	–	70.000	–	–	70.000
Anteilsklasse I/A (EUR)	33.488	70.328	–	(46.737)	57.079
Anteilsklasse I/D (EUR)	–	129.500	–	–	129.500
Anteilsklasse N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse Q/A (EUR)	4.058.366	–	–	(3.484.843)	573.523
Anteilsklasse R/A (EUR)	3.418	231	–	–	3.649
Anteilsklasse RE/A (EUR)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse S/A (EUR)	505.145	2.443.015	–	(32.399)	2.915.761
Anteilsklasse S/D (EUR)	–	341.693	–	(10.745)	330.948
Anteilsklasse S1/A (EUR)	–	2.126.620	–	–	2.126.620
Anteilsklasse S2/A (EUR)	7.200.534	1.961.999	–	(2.411.765)	6.750.768

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	Zum 1. Januar 2023 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2023 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse G/A (EUR)	–	11.600.194	–	–	11.600.194
Anteilsklasse I/A (EUR)	300	1.726.638	–	(70.804)	1.656.134
Anteilsklasse N/A (EUR)	14.900	6.250	–	(14.900)	6.250
Anteilsklasse Q/A (EUR)	10.754.005	17.416.935	–	(12.878.229)	15.292.711
Anteilsklasse R/A (EUR)	1.425	808.257	–	–	809.682
Anteilsklasse RE/A (EUR)	299	–	–	–	299
Anteilsklasse S/A (EUR)	625.458	2.395.425	–	(909.272)	2.111.611
Anteilsklasse S2/A (EUR)	23.170.387	21.869.523	–	(4.004.644)	41.035.266
Anteilsklasse S3/A (EUR)	10.751.259	11.381.012	–	(5.644.126)	16.488.145
Anteilsklasse S3/D (EUR)	300	–	–	–	300

8. KAPITAL (Fortsetzung)

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse C/A (USD)	820.190	4.409	–	(43.690)	780.909
Anteilsklasse C/D (USD)	607.577	496	3.890	(148.602)	463.361
Anteilsklasse CT/A (USD)	458.775	2.132	–	(456.640)	4.267
Anteilsklasse CT/DG (USD)	–	1.000	18	–	1.018
Anteilsklasse CT/DM (USD)	449.260	–	–	(439.130)	10.130
Anteilsklasse F/A (USD)	179.248	–	–	(97.093)	82.155
Anteilsklasse F/DM (USD)	51.709	–	1.414	–	53.123
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	434.957	70.662	–	(129.886)	375.733
Anteilsklasse H-I/D (EUR)	23.330	21.645	–	–	44.975
Anteilsklasse H-I/D (GBP)	154.667	–	–	(2.078)	152.589
Anteilsklasse H-N/A (CHF)	750	–	–	–	750
Anteilsklasse H-N/A (EUR)	213.560	1.276	–	(14)	214.822
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	3.400	–	23	(973)	2.450
Anteilsklasse H-N1/A (EUR)	149.747	129.736	–	(6.474)	273.009
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	5.363.933	34.247	–	(2.604.013)	2.794.167
Anteilsklasse H-R/A (SGD)	3.392.053	692.489	–	(1.530.386)	2.554.156
Anteilsklasse H-R/D (SGD)	584.152	7.373	3.127	(44.827)	549.825
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	119.826	1.190	–	(21.758)	99.258
Anteilsklasse H-S/D (EUR)	76.550	–	–	–	76.550
Anteilsklasse I/A (EUR)	94.286	15.107	–	(21.222)	88.171
Anteilsklasse I/A (USD)	6.411.557	5.304.547	–	(4.956.208)	6.759.896
Anteilsklasse I/D (GBP)	9.990	–	–	–	9.990
Anteilsklasse I/D (USD)	3.934.924	227.631	32.721	(1.113.492)	3.081.784
Anteilsklasse I/DG (USD)	–	1.000	18	–	1.018
Anteilsklasse N/A (USD)	4.882	–	–	–	4.882
Anteilsklasse N/DM (USD)	101.081	–	–	(53.571)	47.510
Anteilsklasse N1/A (USD)	890.495	98.771	–	(140.668)	848.598
Anteilsklasse N1/D (USD)	413.758	82.873	648	–	497.279
Anteilsklasse R/A (EUR)	1.252.653	136.781	–	(825.205)	564.229
Anteilsklasse R/A (SGD)	73.425	798	–	(3.122)	71.101
Anteilsklasse R/A (USD)	7.069.042	1.018.343	–	(2.447.768)	5.639.617
Anteilsklasse R/D (EUR)	–	43.750	779	–	44.529
Anteilsklasse R/D (GBP)	112.981	5.156	–	(7.395)	110.742
Anteilsklasse R/D (SGD)	261.747	10.945	445	(33.194)	239.943
Anteilsklasse R/D (USD)	4.227.000	378.964	26.373	(1.021.098)	3.611.239
Anteilsklasse R/DG (USD)	–	1.000	18	–	1.018
Anteilsklasse R/DM (USD)	2.432.677	418.292	1.500	(775.461)	2.077.008
Anteilsklasse RE/A (EUR)	340.197	2.603	–	(73.352)	269.448
Anteilsklasse RE/A (USD)	6.482.821	603.117	–	(1.041.815)	6.044.123
Anteilsklasse RE/D (USD)	97	–	–	–	97
Anteilsklasse RE/DM (USD)	106	–	–	–	106
Anteilsklasse S/A (USD)	3.198.512	883.736	–	(195.377)	3.886.871
Anteilsklasse S/D (GBP)	3.327	–	1	(2.650)	678
Anteilsklasse S/D (USD)	1.199.159	–	–	(1.160.859)	38.300

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse CT/DM (USD)	168.539	–	–	(168.539)	–
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	131.106	–	–	(51.000)	80.106
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	414	–	8	–	422
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	–	1.161	–	–	1.161
Anteilsklasse I/A (EUR)	165.384	–	–	(96.744)	68.640
Anteilsklasse I/A (USD)	141	–	–	–	141
Anteilsklasse I/D (USD)	327.785	–	48.394	(82.149)	294.030
Anteilsklasse N/DM (USD)	434	–	–	–	434
Anteilsklasse R/A (EUR)	82.202	2.031	–	(19.927)	64.306
Anteilsklasse R/A (USD)	4.280	122	–	(122)	4.280
Anteilsklasse R/D (SGD)	550	–	78	(628)	–
Anteilsklasse R/D (USD)	311.256	9.118	3.248	(67.749)	255.873
Anteilsklasse R/DM (USD)	129.193	163.637	–	(81.782)	211.048
Anteilsklasse S/A (USD)	5.500	–	–	–	5.500

8. KAPITAL (Fortsetzung)

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse C/A (USD)	11.926	1.004	–	–	12.930
Anteilsklasse C/D (USD)	339	–	56	(395)	–
Anteilsklasse H-I/A (SGD)	134.996	51.429	–	(33.843)	152.582
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	359	–	29	–	388
Anteilsklasse H-R/A (EUR)	65.155	44.725	–	(66.594)	43.286
Anteilsklasse H-S/A (EUR)	170.573	–	–	(170.573)	–
Anteilsklasse H-S/A (SEK)	2.448	–	–	(2.448)	–
Anteilsklasse H-S/D (GBP)	2.475.502	–	18	(160)	2.475.360
Anteilsklasse I/A (USD)	1.901.811	689.800	–	(363.365)	2.228.246
Anteilsklasse I/D (USD)	521.713	6.745	59.748	(518.839)	69.367
Anteilsklasse N/A (EUR)	308	–	–	(302)	6
Anteilsklasse N1/A (USD)	12.754	3.888	–	(1.754)	14.888
Anteilsklasse R/A (EUR)	189.914	37.573	–	(33.553)	193.934
Anteilsklasse R/A (USD)	28.788	110	–	–	28.898
Anteilsklasse R/D (GBP)	13.204	1.780	–	(1.602)	13.382
Anteilsklasse R/D (USD)	171.550	20.510	6.238	(34.727)	163.571
Anteilsklasse RE/A (USD)	300	–	–	(300)	–

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (EUR)	–	230.335	–	(181.213)	49.122
Anteilsklasse H-Q/A (EUR)	2.500.000	–	–	(242.483)	2.257.517
Anteilsklasse I/A (USD)	287	–	–	–	287
Anteilsklasse R/A (USD)	287	–	–	–	287

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse H-I/A (CHF)	–	300	–	–	300
Anteilsklasse H-N/A (CHF)	–	300	–	–	300
Anteilsklasse H-R/A (CHF)	–	300	–	–	300
Anteilsklasse I/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse Q/A (EUR)	1.762.817	–	–	–	1.762.817
Anteilsklasse R/A (EUR)	10	195	–	–	205
Anteilsklasse RE/A (EUR)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse S/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse S2/A (EUR)	1.452.152	236.930	–	(422.720)	1.266.362

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse I/A (EUR)	50.688	30.218	–	(47.418)	33.488
Anteilsklasse N/A (EUR)	10	–	–	–	10
Anteilsklasse Q/A (EUR)	7.000.000	–	–	(2.941.634)	4.058.366
Anteilsklasse R/A (EUR)	10	3.408	–	–	3.418
Anteilsklasse RE/A (EUR)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse S/A (EUR)	10	505.135	–	–	505.145
Anteilsklasse S2/A (EUR)	5.127.128	3.285.182	–	(1.211.776)	7.200.534

8. KAPITAL (Fortsetzung)

Anzahl der ausgegebenen und voll eingezahlten Anteile (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	Zum 1. Januar 2022 ausgegebene Anteile	Ausgegebene Anteile	Reinvestierte Anteile	Zurückgenommene Anteile	Zum 31. Dezember 2022 ausgegebene Anteile
Anteilsklasse I/A (EUR)	300	–	–	–	300
Anteilsklasse N/A (EUR)	14.900	–	–	–	14.900
Anteilsklasse Q/A (EUR)	6.636.246	6.620.272	–	(2.502.513)	10.754.005
Anteilsklasse R/A (EUR)	300	1.125	–	–	1.425
Anteilsklasse RE/A (EUR)	299	–	–	–	299
Anteilsklasse S/A (EUR)	300	626.002	–	(844)	625.458
Anteilsklasse S2/A (EUR)	11.378.962	15.725.818	–	(3.934.393)	23.170.387
Anteilsklasse S3/A (EUR)	–	12.337.677	–	(1.586.418)	10.751.259
Anteilsklasse S3/D (EUR)	–	300	–	–	300

Die sieben Zeichnungsanteile wurden begeben und bis zur Höhe von USD 7 voll eingezahlt. Da sie nicht zu den rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen der Gesellschaft gehören, sind sie nicht dem Nettoinventarwert der Gesellschaft zuzurechnen. Daher wird im Abschluss nur in dieser Erläuterung auf sie Bezug genommen.

Mit den Anteilen verbundene Rechte

Die Inhaber von Zeichnungsanteilen sind bei einer Abstimmung per Handzeichen zu einer Stimme pro Inhaber und bei einer schriftlichen Abstimmung zu einer Stimme pro Zeichnungsanteil berechtigt. Die Inhaber von Zeichnungsanteilen sind zu keiner Dividende berechtigt, und im Falle der Liquidation oder Auflösung der Gesellschaft haben sie unter der Voraussetzung, dass hierfür ausreichende Mittel vorhanden sind, ein Anrecht auf Rückzahlung der Kapitalsumme. Die Inhaber von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen sind bei einer Abstimmung per Handzeichen zu einer Stimme pro Inhaber und bei einer schriftlichen Abstimmung zu einer Stimme pro rückzahlbarem, gewinnberechtigten Anteil berechtigt. Die Inhaber von rückzahlbaren gewinnberechtigten Anteilen sind zu den vom Verwaltungsrat festgelegten Dividenden berechtigt, und im Falle der Liquidation oder Auflösung der Gesellschaft verfügen sie über die im Verkaufsprospekt der Gesellschaft spezifizierten Rechte.

Weder mit den Zeichnungsanteilen noch mit den rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen sind irgendwelche Vorzugs- oder Bezugsrechte verknüpft.

9. GEBÜHREN

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsgesellschaft eine feste monatliche Gebühr zum unten aufgeführten Satz*. Die Verwaltungsgesellschaft erhielt USD 10.968.500 im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 (31. Dezember 2022: USD 10.471.574), wovon USD 2,008,884 zum 31. Dezember 2023 ausstanden (31. Dezember 2022: USD 885.298).

Anteilsklasse	Loomis Sayles Multisector Income Fund	Loomis Sayles High Income Fund	Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	Loomis Sayles Euro High Yield Fund	Loomis Sayles Euro Credit Fund	Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Anteilsklasse C	1,95 %	n. z.	1,95 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse CT	1,35 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse F	1,05 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse G	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,75 %
Anteilsklasse H-F	n. z.	n. z.	1,05 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-I	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	n. z.
Anteilsklasse H-N	0,75 %	0,75 %	0,75 %	n. z.	0,75 %	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-N1	0,75 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-R	1,25 %	1,65 %	1,25 %	n. z.	1,25 %	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-RE	1,60 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Klasse H-S	0,75 %	n. z.	0,75 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-Q	n. z.	n. z.	n. z.	0,00 %	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse I	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Anteilsklasse N	0,75 %	0,75 %	0,75 %	n. z.	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Anteilsklasse N1	0,75 %	n. z.	0,75 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse Q	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,00 %	0,00 %	0,00 %
Anteilsklasse R	1,25 %	1,65 %	1,25 %	1,35 %	1,25 %	1,25 %	0,75 %
Anteilsklasse RE	1,60 %	n. z.	n. z.	n. z.	1,60 %	1,60 %	0,75 %
Anteilsklasse S	0,75 %	0,75 %	n. z.	n. z.	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Anteilsklasse S1	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,75 %	n. z.
Anteilsklasse S2	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,75 %	0,75 %	0,75 %
Anteilsklasse S3	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,75 %

* Anteilsklassen ohne Aufwandsobergrenzen sind entweder inaktiv oder ungedeckt.

9. GEBÜHREN (Fortsetzung)

Die Vertriebsgebühren für die Anteilsklasse CT sind in den Portfolioverwaltungsgebühren enthalten und beliefen sich für den Loomis Sayles Multisector Income Fund sowie den Loomis Sayles High Income Fund in dem Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 auf USD 1.013 bzw. USD 0 (31. Dezember 2022: USD 34.503 bzw. USD 3.367).

Die Verwaltungsgesellschaft vergütet den Fonds alle Aufwendungen, die die folgenden Prozentsätze des Nettoinventarwerts der einzelnen Fonds überschreiten*:

Anteilsklasse	Loomis Sayles Multisector Income Fund	Loomis Sayles High Income Fund	Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	Loomis Sayles Euro High Yield Fund	Loomis Sayles Euro Credit Fund	Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Anteilsklasse C	2,25 %	n. z.	2,25 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse CT	2,50 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse F	1,25 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse G	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,25 %
Anteilsklasse H-F	n. z.	n. z.	0,20 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-I	0,90 %	0,90 %	0,90 %	1,00 %	0,65 %	0,50 %	n. z.
Anteilsklasse H-N	0,90 %	0,90 %	0,90 %	n. z.	0,75 %	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-N1	0,80 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-R	1,50 %	1,95 %	1,50 %	n. z.	1,30 %	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-RE	1,80 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Klasse H-S	0,60 %	n. z.	0,55 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse H-Q	n. z.	n. z.	n. z.	0,25 %	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse I	0,90 %	0,90 %	0,90 %	1,00 %	0,65 %	0,50 %	0,50 %
Anteilsklasse N	0,90 %	0,90 %	0,90 %	n. z.	0,75 %	0,60 %	0,60 %
Anteilsklasse N1	0,80 %	n. z.	0,80 %	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.
Anteilsklasse Q	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,25 %	0,25 %	0,25 %
Anteilsklasse R	1,50 %	1,95 %	1,50 %	1,75 %	1,30 %	1,00 %	1,00 %
Anteilsklasse RE	1,80 %	n. z.	n. z.	n. z.	1,50 %	1,20 %	1,20 %
Anteilsklasse S	0,60 %	0,75 %	n. z.	n. z.	0,50 %	0,40 %	0,40 %
Anteilsklasse S1	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,35 %	n. z.
Anteilsklasse S2	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,45 %	0,30 %	0,30 %
Anteilsklasse S3	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	n. z.	0,25 %

* Anteilsklassen ohne Aufwandsobergrenzen sind entweder inaktiv oder ungedeckt.

Beträge in Höhe von USD 206.986, USD 63.933, USD 11.820 , USD 0, EUR 74.905. EUR 560.800 EUR und EUR 2.181.970 wurden für das am Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 an den Loomis Sayles Multisector Income Fund, den Loomis Sayles High Income Fund, den Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, den Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, den Loomis Sayles Euro High Yield Fund, den Loomis Sayles Euro Credit Fund bzw. den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund vergütet (31. Dezember 2022: USD 247.189, USD 161.817, USD 191.833 und USD 168.969, EUR 115.676, EUR 257.823 bzw. EUR 1.303.206).

Die Gesellschaft zahlt der Verwaltungsstelle rückwirkend eine monatliche Gebühr in Höhe von 1/12 der folgenden Prozentsätze des Nettoinventarwerts jedes Fonds zu jedem Bewertungszeitpunkt: 0,03 % auf die ersten USD 75 Mio., 0,02 % auf die nächsten USD 75 Mio. und 0,01 % auf den Restbetrag über USD 150 Mio. (oder äquivalenter Betrag), gegebenenfalls zusammen mit Mehrwertsteuer. Die Gebühren für die Verwaltungsstelle werden täglich kumuliert und monatlich rückwirkend gezahlt.

Die Gesellschaft zahlt der Verwahrstelle eine monatliche Gebühr zwischen 0,005 % und 0,45 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds zu jedem Bewertungszeitpunkt als Gebühr für Verwahrungsdienstleistungen sowie Transaktionsgebühren zu gängigen Sätzen. Die Gesellschaft zahlt rückwirkend eine monatliche Gebühr in Höhe von 1/12 von 0,012 % des Nettoinventarwerts jedes Fonds für Treuhanddienstleistungen.

Für das am 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr erhielt Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited eine Verwaltungsgebühr in Höhe von USD 79.76231. Dezember 2022 (31. Dezember 2020: USD 377.547), wovon USD 0 (31. Dezember 2022: USD 189.288) zum Ende des Geschäftsjahres ausstanden.

Für das am 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr erhielt Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited eine Gebühr für Verwahrungsdienstleistungen sowie Transaktionsgebühren in Höhe von USD 27.297 (31. Dezember 2022: USD 210.323), wovon USD 61.229 (31. Dezember 2022: USD 135.334) zum Ende des Geschäftsjahres ausstanden.

Für das am 31. Dezember 2023 zu Ende gegangene erhielt Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited Treuhandgebühr eine Treuhandgebühr in Höhe von USD 24.316 (31. Dezember 2022: USD 50.332), wovon USD 0 (31. Dezember 2022: USD 4.941) zum Ende des Geschäftsjahres ausstanden.

9. GEBÜHREN (Fortsetzung)

Die Transaktionskosten sind in den sonstigen Aufwendungen in Erläuterung 3 enthalten und beliefen sich auf USD 649, USD 0, USD 1.103, USD 21.169, EUR 0, EUR 0 und EUR 0 (31. Dezember 2022: USD 4.640, USD 7, USD 0, USD 10.970, EUR 0, EUR 0 und EUR 0) für den Loomis Sayles Multisector Income Fund, den Loomis Sayles High Income Fund, den Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, den Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, den Loomis Sayles Euro High Yield Fund, den Loomis Sayles Euro Credit Fund bzw. den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund für dasam 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr.

10. HONORAR DES ABSCHLUSSPRÜFERS

Die folgenden Tabellen zeigen die Vergütungen, die den Abschlussprüfern in den am 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 abgelaufenen Geschäftsjahren gezahlt wurden.

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2023	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FONDS USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FONDS USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FONDS EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FONDS EUR	GESAMT USD
HONORAR DES ABSCHLUSSPRÜFERS								
Gesetzliches Honorar des Abschlussprüfers	28.050	28.050	29.350	28.050	26.569	26.569	26.569	201.548
Sonstige, nicht mit der Rechnungsprüfung zusammenhängende Gebühren[(1)]	15.952	12.798	5.653	-	874	4.986	5.464	46.912
	44.002	40.848	35.003	28.050	27.443	31.555	32.033	248.460

GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. Dezember 2022	LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FONDS USD	LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND USD	LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FONDS USD	LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FONDS USD	LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FONDS EUR	LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND EUR	LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FONDS EUR	GESAMT USD
HONORAR DES ABSCHLUSSPRÜFERS								
Gesetzliches Honorar des Abschlussprüfers	27.997	27.160	27.159	27.160	24.942	24.942	24.942	189.334
Sonstige, nicht mit der Rechnungsprüfung zusammenhängende Gebühren[(1)]	4.501	466	809	184	572	1.076	2.263	10.134
	32.498	27.626	27.968	27.344	25.514	26.018	27.205	199.468

[(1)] Die sonstigen, nicht mit der Rechnungsprüfung zusammenhängenden Gebühren sind im Posten „Operative Aufwendungen" der Gesamterfolgsrechnung enthalten und beziehen sich auf Erläuterung 3. Für das am 31. Dezember 2023 abgelaufene Geschäftsjahr erbrachte PwC Société coopérative Steuerberatungsleistungen (31. Dezember 2022: ebenfalls). Steuerberatungsleistungen sind im Posten „Honorare" in der Gesamterfolgsrechnung erfasst. In der oben genannten Vergütung ist die Mehrwertsteuer enthalten.

11. STEUERN

Nach der aktuellen Gesetzgebung und Praxis gilt die Gesellschaft als Anlageorganismus im Sinne von Abschnitt 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 in seiner aktuellen Fassung. Daher sind ihre Erträge oder Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Bei Eintritt eines „besteuerbaren Ereignisses" kann jedoch eine Steuerpflicht gemäß irischem Steuerrecht entstehen. Zu den Steuerereignissen zählen u. a. Ausschüttungen an Anteilinhaber oder die Einlösung, Rücknahme, Stornierung oder Übertragung von Anteilen für irische Steuerzwecke, das Halten von Anteilen der Gesellschaft über einen Zeitraum von acht Jahren oder darüber hinaus oder die Zuteilung bzw. Entwertung von Anteilen durch die Gesellschaft zur Begleichung einer Steuerschuld für aus einer Übertragung erzielte Gewinne. Nicht mit irischen Steuern besteuerbar sind Ereignisse in Bezug auf:

a) Anteilinhaber, die zum Zeitpunkt des Steuerereignisses weder den Steuerstatus eines „Irish Resident" noch den eines „Irish Ordinary Resident" haben, vorausgesetzt, die Gesellschaft verfügt über entsprechende gültige Erklärungen gemäß Schedule 2B des TCA und die Gesellschaft ist nicht im Besitz von Informationen, die zu der begründeten Annahme Anlass geben, dass die darin enthaltenen Informationen nicht länger im Wesentlichen korrekt sind, oder die Gesellschaft wurde von der irischen Steuerbehörde (Irish Revenue Commissioners) autorisiert, Bruttozahlungen zu leisten, wenn keine entsprechende Erklärung vorliegt; oder

b) Anteilinhaber, die zum Zeitpunkt des Steuerereignisses steuerbefreite irische Anleger sind (wie in Section 739D definiert), vorausgesetzt, die Gesellschaft verfügt über gültige Erklärungen gemäß Schedule 2B des TCA und die Gesellschaft ist nicht im Besitz von Informationen, die zu der begründeten Annahme Anlass geben, dass die darin enthaltenen Informationen nicht länger im Wesentlichen korrekt sind, oder die Gesellschaft wurde von den Irish Revenue Commissioners ermächtigt, Bruttozahlungen in Ermangelung von angemessenen Erklärungen zu leisten.

Im Geschäftsjahr gab es keine besteuerbaren Ereignisse.

Gegebenenfalls von der Gesellschaft durch getätigte Anlagen erwirtschaftete Kapitalgewinne, Dividenden und Zinsen können in den Ländern, in denen die betreffenden Anlageerträge erzielt wurden, einer Steuer unterliegen, für die unter Umständen weder für die Gesellschaft noch für die Anteilinhaber ein Rückerstattungsanspruch besteht.

Gemäß dem TCA kann die irische Steuerbehörde (Revenue Commissioners) außerhalb Irlands vertriebenen Investmentfonds genehmigen, Zahlungen an nicht in Irland ansässige Anleger ohne Abzug irischer Steuern vorzunehmen, sofern keine entsprechende Erklärung vorliegt und „gleichwertige Maßnahmen" getroffen wurden. Um eine entsprechende Genehmigung zu erhalten, muss eine Gesellschaft einen schriftlichen Antrag an die Revenue Commissioners richten und darin die Erfüllung der entsprechenden Voraussetzungen bestätigen.

12. ANGABEN ÜBER BEZIEHUNGEN ZU NAHE STEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Unternehmen und Personen werden als nahe stehend bezeichnet, wenn eines dieser Unternehmen bzw. eine dieser Personen in der Lage ist, das andere Unternehmen bzw. die andere Person zu kontrollieren oder in Bezug auf finanzielle und operative Entscheidungen erheblich zu beeinflussen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sowie Natixis Investment Managers S.A., die Verwaltungsgesellschaft und die Vertriebsstelle der Gesellschaft sind auf Seite 4 aufgeführt. Die im Geschäftsjahr an diese Parteien gezahlten Beträge sind in Erläuterung 3 spezifiziert. Forderungen und Verbindlichkeiten gegenüber der Verwaltungsgesellschaft und der Vertriebsstelle sind in den Erläuterungen 6 bzw. 7 dargestellt. Einzelheiten zu der Gebühr für den Portfolioverwalter und die Verwaltungsstelle sind in Erläuterung 9 aufgeführt. Loomis, Sayles & Company, L.P. ist der Portfolioverwalter der Gesellschaft. Die Verwaltungsgesellschaft leistet aus den an ihn geflossenen Gebühren die Gebühren- und Aufwandszahlungen an den Portfolioverwalter.

Natixis Investment Managers S.A. und Loomis, Sayles & Company, L.P. sind Tochtergesellschaften der Natixis Investment Managers Group, einer internationalen Vermögensverwaltungsgruppe mit Sitz in Paris, Frankreich, deren Muttergesellschaft Natixis in Paris (Frankreich) ist.

Jason Trepanier ist Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und gleichzeitig Geschäftsführer von Natixis Investment Managers S.A., die als Verwaltungsgesellschaft, Initiator und Vertriebsstelle der Gesellschaft fungiert. Lynda Wood (geb. Schweitzer) ist Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und gleichzeitig Geschäftsführerin von Loomis, Sayles & Company, L.P., dem Portfolioverwalter. Christopher Yiannakou ist Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und Geschäftsführer von Loomis Sayles Investments Limited, UK (einer hundertprozentigen Tochtergesellschaft des Portfolioverwalters).

Mit Wirkung vom 1. April 2024 hat Natixis Investment Managers International Natixis Investment Managers S.A. als Verwaltungsgesellschaft und Vertriebsstelle der Gesellschaft abgelöst und Loomis Sayles (Netherlands) B.V. ersetzt Loomis, Sayles & Company, L.P. als Anlageverwalter des Loomis Sayles Euro High Yield Fund, des Loomis Sayles Euro Credit Fund und des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

12. ANGABEN ÜBER BEZIEHUNGEN ZU NAHE STEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN (Fortsetzung)

Die Führung der finanziellen und operativen Geschäfte der Fonds – und damit auch die Kontrolle – obliegt den Anteilinhabern im Rahmen der Hauptversammlung. Unter Angabe der Vergleichszahlen vom 31. Dezember 2022 hielten zum 31. Dezember 2023 folgende Organismen Beteiligungen von über 20 % am umlaufenden Anteilskapital des Fonds:

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Multisector Income Fund				
Allfunds Bank	–	–	9.107.726	21 %

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles High Income Fund				
RBC cees Nominees Ltd	180.062	24 %	294.030	30 %
Taiwan Agent - Natixis	236.488	32 %	277.374	28 %

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund				
FundSettle EOC Nominees	–	–	2.010.250	37 %
Taiwan Agent - Natixis	642.031	54 %	–	–
The Royal Literary Fund	–	–	2.475.360	46 %
UBS Natixis	279.974	24 %	–	–

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund				
Kennedy Fin Lux S.à.r.l.-Natixis Dub	2.257.517	100 %*	2.257.517	98 %

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Euro High Yield Fund				
Clearstream Banking S.A.-Natixis	1.230.000	38 %	1.075.712	35 %
Kennedy Fin Lux S.a.r.l.-Natixis Dub	1.711.797	53 %	1.762.817	58 %

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Euro Credit Fund				
FundSettle EOC Nominees	3.405.457	26 %	–	–
International Fund Services&Asset Mgt SA	4.878.869	38 %	4.974.526	42 %
Kennedy Fin Lux S.a.r.l.-Natixis Dub	–	–	4.058.366	34 %

	31. Dezember 2023		31. Dezember 2022	
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**	**Anzahl Anteile**	**% des Fonds**
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund				
FundSettle EOC Nominees	–	–	11.373.678	25 %

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS

Strategien bei der Verwendung von Finanzinstrumenten

Die Fonds sind aufgrund ihrer Anlageaktivitäten verschiedenen Finanzrisiken ausgesetzt: dem Marktrisiko (einschließlich des Marktpreis-, Währungs- und Zinsrisikos und des Derivatrisikos), dem Bonitäts- sowie dem Liquiditätsrisiko. Im Mittelpunkt des Risikomanagements der Gesellschaft steht die Unberechenbarkeit der Finanzmärkte. Ziel ist es, negative Folgen für die Finanzperformance der Fonds zu minimieren. Der Portfolioverwalter wendet ein Risikomanagementverfahren an. Die damit verbundenen Aktivitäten sind nachstehend beschrieben.

Der Portfolioverwalter setzt die Überwachung des Liquiditätsrisikos um, indem er neue Verfahren im Hinblick auf die Korrelation zwischen den Liquiditätsrisiken für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten anwendet, um Liquiditätsprobleme vorauszusehen. Ansonsten haben beide Parteien das Managementverfahren für das Marktpreis-, Währungs-, Zins-, Bonitäts- und Liquiditätsrisiko seit dem Ende des vorangegangenen Geschäftsjahres nicht verändert.

* über 99 % hinaus.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Strategien bei der Verwendung von Finanzinstrumenten (Fortsetzung)

Das IROC („Investment Risk Oversight Committee“) ist das wichtigste Kontrollorgan des Portfolioverwalters in Bezug auf die Überwachung des Anlagerisikos im Zusammenhang mit der Geschäftstätigkeit der Fonds.

Mit einem Marktrisiko behaftete Aktivitäten werden vom Portfolioverwalter gegebenenfalls im Rahmen der Überwachung der für die einzelnen Fonds eingeführten wichtigen Risikoindikatoren (Key Risk Indicators, KRIs) überwacht. Diese werden vom IROC überprüft. Ferner werden die mit einem Bonitätsrisiko behafteten Aktivitäten vom Portfolioverwalter gegebenenfalls im Rahmen der Überwachung der Investment Compliance-Richtlinien, der genehmigten Makler und Gegenparteien und der für die einzelnen Fonds eingeführten wichtigen Risikoindikatoren überwacht. Aufgrund der Ergebnisse dieser Überwachung kann der Risikoverwalter den Portfolioverwalter von Zeit zu Zeit überprüfen.

Das IROC fungiert als Prüf- und Validierungsorgan für die Aktivitäten im Hinblick auf die Steuerung des Finanzrisikos und erstellt regelmäßige Berichte für den Verwaltungsrat der Gesellschaft. Wenn Markt-, Bonitäts- oder Liquiditätsrisiken Anlass zur Sorge geben, wird die betreffende Angelegenheit gegebenenfalls an den Verwaltungsrat der Gesellschaft weitergeleitet. Auf Basis der Einschätzung des Risikoprofils der einzelnen Fonds durch den Portfolioverwalter verwendet die Gesellschaft den Commitment-Ansatz, um das Gesamtrisiko der Gesellschaft in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Central Bank of Ireland zu berechnen, mit Ausnahme des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, bei dem der absolute Value at Risk (VaR)-Ansatz angewendet wird.

Marktpreisrisiko

Alle Anlagen in Wertpapiere sind mit einem Kapitalverlustrisiko verbunden.

Auf der ersten Kontrollebene verringert der Portfolioverwalter dieses Risiko, indem er innerhalb bestimmter im Prospekt der Gesellschaft festgelegter Grenzen eine sorgfältige Auswahl von Wertpapieren und anderen Finanzinstrumenten trifft.

Die allgemeinen Marktpositionen der Fonds werden auf täglicher Basis durch den Portfolioverwalter überwacht und vom Verwaltungsrat regelmäßig bei dessen Sitzungen überprüft.

Die Aktien der Fonds sind einem Marktpreisrisiko ausgesetzt, das aus der Ungewissheit der zukünftigen Kursentwicklung der Instrumente entsteht.

Das Marktpreisrisiko der Fonds wird durch Diversifizierung der Engagements des Anlageportfolios gesteuert.

Im Rahmen der Steuerung des Marktpreisrisikos durch den Portfolioverwalter führen erfahrene Wertpapieranalysten eine gründliche Analyse der einzelnen Wertpapiere durch, und eine professionelle Handelsabteilung sammelt Informationen über den Markt für diese Wertpapiere. Die von den Analysten und Händlern zusammengetragenen Informationen werden anschließend von erfahrenen Portfolioverwaltern ausgewertet, die letztendlich entscheiden, ob ein Titel gekauft oder verkauft wird.

Darüber hinaus hat der Portfolioverwalter ein Team für quantitatives Research und Risikomanagement eingerichtet, das die Anlageentscheidungen unterstützen soll. Hierzu werden quantitative Instrumente und Modelle erstellt, als Ergänzung der fundamentalen Erfahrung in der Wirtschaft und an den Märkten. Der Portfolioverwalter verfügt über komplexe eigene Ressourcen für die Anlageanalyse, darunter verschiedene Risikomanagement-Tools. Mit diesen Tools werden allgemeine Risikomerkmale, der ex-ante Tracking Error, das Positionsrisiko, die Performance-Attribution, Top-Down-Bewertungen und die Performance-Streuung überprüft.

Das wichtigste Risikomanagementsystem, das entwickelt wurde, bietet umfangreiche Informationen wie etwa tägliche Positionen, Gewichtungen, Eigenschaften und Statistiken. Speziell analysiert das Risiko-Tool die Duration und Renditekurve, Währungen, Länder, Sektoren, die Bonität, Branchen, das Risiko vorzeitiger Rückzahlungen und den Tracking Error.

Ergänzt wird das Tool durch zusätzliche Marktrisiko-Tools, die den ex-ante Tracking Error, die ex-post Überschussrendite und die Renditeoptimierung ermitteln. Mit anderen eigenen Risikosystemen wird die Performance-Attribution durch eine gründliche Analyse der Duration, der Spread-Duration, der Bonitäts- und Sektorallokation sowie der Wertpapierauswahl berechnet.

Das Positionsrisiko wird durch Systeme überwacht, die die Positionsgröße, den Option-Adjusted-Spread (OAS) gegenüber Ratings hoher Qualität sowie seine Veränderung, den Ratingausblick von Loomis Sayles, Liquiditätsrisiken, die Korrelation mit dem Markt sowie die unternehmensweiten Positionsgrößen analysieren.

Der Portfoliomanager greift auf Bloomberg, Citigroup Yield Book und Barclays POINT als Anbieter von Analysedaten zurück. Wenn ein Wertpapier einem Benchmark-Sponsor gehört (z. B. Merrill Lynch), verwendet er die Analysen des Benchmark-Sponsors. An erster Stelle wird Bloomberg genutzt und für Hypothekenpapiere Citigroup Yield Book. Der wichtigste Vorteil dieser Anbieter ist ihre Fähigkeit, Analysedaten für sämtliche Arten von Wertpapieren zur Verfügung zu stellen, in erster Linie für Wertpapiere mit eingebetteten Optionen sowie strukturierte Wertpapiere.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Marktpreisrisiko (Fortsetzung)

Auf der zweiten Kontrollebene behält der Portfolioverwalter eine ausreichende Übersicht über die von den Fonds eingegangenen Risiken.

Nach der Festlegung des Risikoprofils für den jeweiligen Fonds unter Berücksichtigung des Anlageklassen-Engagements, der Komplexität der Anlagestrategie sowie der Komplexität, des Umfangs und der Häufigkeit der zu verwendenden derivativen Finanzinstrumente bzw. strukturierten Produkte überwacht der Portfolioverwalter eigenständig die spezifischen Risiken des Fonds. Der Portfolioverwalter hat entsprechende wichtige Risikoindikatoren (Key Risk Indicators, „KRIs“) ausgewählt (z. B. VaR, Tracking Error), die derzeit von darauf spezialisierten Risikoteams mithilfe verschiedener interner und externer Systeme täglich überwacht werden. Die Liste der KRIs und die entsprechenden Grenzwerte werden mindestens einmal jährlich im Hinblick auf ihre Relevanz überwacht und dem Verwaltungsrat mitgeteilt.

Ferner ist die Pricing Oversight-Gruppe des Portfolioverwalters verantwortlich für die Überwachung der Preisbildung der Fonds und der Einhaltung der entsprechenden Preisbildungsrichtlinien und -verfahren.

Die Marktpreisrisiko-Konzentrationen der Fonds zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 sind in ihren Vermögensaufstellungen auf den Seiten 131 bis einschließlich 232 angegeben.

Loomis Sayles Multisector Income Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Multisector Income Fund um etwa USD 243.154 höher bzw. niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: USD 218.769) gezahlt wurden.

Loomis Sayles High Income Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles High Income Fund um etwa USD 275 höher bzw. niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: USD 123) gezahlt wurden.

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund weder höher noch niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: keine Veränderung).

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund um etwa USD 857.581 höher bzw. niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: USD 833.245) gezahlt wurden.

Loomis Sayles Euro High Yield Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Euro High Yield Fund weder höher noch niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: null).

Loomis Sayles Euro Credit Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Euro Credit Fund weder höher noch niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: null).

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Wenn der Marktpreis zum 31. Dezember 2023 um 10 % höher bzw. niedriger gelegen hätte (bei ansonsten konstanten Variablen), wäre das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund weder höher noch niedriger ausgefallen (31. Dezember 2022: null).

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko

Maßgeblichen Einfluss auf die Fonds haben die Zinsen und die Kreditspreads der Anleihen, die sich in den Portfolios befinden. Die damit verbundenen Risiken werden im Abschnitt über die Zins- bzw. Bonitätsrisiken behandelt.

Als Währungsrisiko wird das Risiko einer Schwankung des Zeitwerts oder der künftigen Cashflows eines Finanzinstruments aufgrund von Wechselkursveränderungen bezeichnet. Die Vermögenswerte, Verbindlichkeiten und Erträge der Fonds lauten teilweise nicht auf USD (die funktionale Währung). Die Fonds sind daher einem Währungsrisiko ausgesetzt, da der Wert der nicht in USD denominierten Wertpapiere bedingt durch Wechselkursänderungen schwankt. Erträge in ausländischer Währung werden bei Erhalt in US-Dollar umgerechnet.

Der Portfolioverwalter setzt zur Steuerung des Währungsrisikos zum Teil Devisenterminkontrakte für Hedgingzwecke ein. Diese Kontrakte verpflichten den Inhaber, die Währung an einem bestimmten Datum zu einem bestimmten Preis zu kaufen oder verkaufen. Dadurch kann der Wert bestimmter Portfoliopositionen abgesichert werden. Zudem können Devisentermingeschäfte genutzt werden, wenn Änderungen des relativen Werts von Währungen erwartet werden, in denen aktuelle oder zukünftige Portfoliopositionen denominiert sind. Wenn die Fonds lediglich zur Absicherung (Hedging) in Devisenterminkontrakte investieren, können die Positionen in diesen Kontrakten gegeneinander verrechnet werden, sodass sich das Gesamtrisiko verringert.

In den folgenden Tabellen ist das Währungsrisiko der Gesellschaft zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022, einschließlich einer Sensibilitätsanalyse, dokumentiert.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Forts.)

Konzentration von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten

Finanzielle Vermögenswerte – Angaben in USD

31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete monetäre Vermögenswerte	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht-monetäre Vermögenswerte	Bankguthaben	Kurzfristige Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	Summe	Sensitivitäts-analyse[*1]
Euro	1.864.151	–	26	38.126	1.902.303	186.418
Indonesische Rupiah	2.621.509	–	–	51.574	2.673.083	262.151
Mexikanischer Peso	2.630.404	–	–	15.127	2.645.531	263.040
Singapur-Dollar	–	–	–	36	36	–
Südafrikanischer Rand	2.665.529	–	–	94.510	2.760.039	266.553
Andere Währungen	–	–	–	13	13	–
	9.781.593	–	26	199.386	9.981.005	978.162

Zum 31. Dezember 2023 war der überwiegende Teil der Verbindlichkeiten des Loomis Sayles Multisector Income Fund in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

Zum 31. Dezember 2023 waren der Großteil der Vermögenswerte des Loomis Sayles High Income Fund und der Großteil seiner Verbindlichkeiten in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete monetäre Vermögenswerte	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht-monetäre Vermögenswerte	Bankguthaben	Kurzfristige Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	Summe	Sensitivitäts-analyse[*1]
Britisches Pfund	639.815	–	19.733	3.389	662.937	65.955
Kanadischer Dollar	429.363	–	5.701	1.354	436.418	43.506
Chinesischer Renminbi-Yuan	953.698	–	3.974	22.206	979.878	95.767
Euro	3.256.207	–	41.443	39.933	3.337.583	329.765
Japanischer Yen	910.270	–	3.059	373	913.702	91.333
Andere Währungen	2.261.287	–	38.203	32.569	2.332.059	229.949
	8.450.640	–	112.113	99.824	8.662.577	856.275

Zum 31. Dezember 2023 war der überwiegende Teil der Verbindlichkeiten des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

[*1] Die Sensitivitätsanalyse zeigt, wie das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen jedes Fonds gestiegen/(gesunken) wäre, hätte der Wechselkurs zwischen dem US-Dollar und der jeweiligen Währung um 10 % höher/(niedriger) gelegen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Forts.)

Konzentration der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte – Angaben in USD (Fortsetzung)

31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete monetäre Vermögenswerte	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht-monetäre Vermögenswerte	Bankguthaben	Kurzfristige Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	Summe	Sensitivitäts-analyse[*1]
Indische Rupie	671.781	–	10.492	–	682.273	68.227
Mexikanischer Peso	592.177	–	88.790	3.206	684.173	68.097
Südafrikanischer Rand	654.287	–	64.769	21.147	740.203	71.906
Neuer Taiwan-Dollar	630.958	–	19.717	438	651.113	65.068
Uruguayischer Peso	647.501	–	–	6.548	654.049	64.750
Andere Währungen	2.529.119	–	446.430	22.611	2.998.160	297.554
	5.725.823	–	630.198	53.950	6.409.971	635.602

[*1] Die Sensitivitätsanalyse zeigt, wie das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen jedes Fonds gestiegen/(gesunken) wäre, hätte der Wechselkurs zwischen dem US-Dollar und der jeweiligen Währung um 10 % höher/(niedriger) gelegen.

Zum 31. Dezember 2023 war der überwiegende Teil der Verbindlichkeiten des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

Finanzielle Vermögenswerte – Angaben in EUR

Zum 31. Dezember 2023 waren der Großteil der Vermögenswerte des Loomis Sayles Euro High Yield Fund, des Loomis Sayles Euro Credit Fund und des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund sowie der Großteil ihrer Verbindlichkeiten in EUR denominiert, der funktionalen Währung der Fonds.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Forts.)

Konzentration der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte – Angaben in USD

31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

Zum 31. Dezember 2022 waren der Großteil der Vermögenswerte des Loomis Sayles Multisector Income Fund und der Großteil seiner Verbindlichkeiten in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

Zum 31. Dezember 2022 waren der Großteil der Vermögenswerte des Loomis Sayles High Income Fund und der Großteil seiner Verbindlichkeiten in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete monetäre Vermögenswerte	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht-monetäre Vermögenswerte	Bankguthaben	Kurzfristige Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	Summe	Sensitivitäts-analyse[*1]
Britische Pfund	2.752.258	–	119.548	13.642	2.885.448	287.181
Kanadischer Dollar	1.624.387	–	11.951	12.292	1.648.630	163.634
Chinesischer Renminbi-Yuan	3.875.940	–	37.081	56.096	3.969.117	391.302
Euro	11.026.254	–	164.193	93.953	11.284.400	1.119.045
Japanischer Yen	3.612.463	–	83.031	2.929	3.698.423	369.549
Andere Währungen	8.368.535	–	295.523	117.493	8.781.551	866.405
	31.259.837	–	711.327	296.405	32.267.569	3.197.116

Zum 31. Dezember 2022 war der überwiegende Teil der Verbindlichkeiten des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete monetäre Vermögenswerte	Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht-monetäre Vermögenswerte	Bankguthaben	Kurzfristige Forderungen aus Lieferungen und Leistungen	Summe	Sensitivitäts-analyse[*1]
Euro	10.363	–	255.775	12.388	278.526	26.614
Indische Rupie	422.600	–	1.071	226	423.897	42.367
Koreanischer Won	239.015	–	102	6.485	245.602	23.912
Südafrikanischer Rand	111.705	–	76.025	2.254	189.984	18.773
Neuer Taiwan-Dollar	291.499	–	90	572	292.161	29.159
Andere Währungen	810.234	–	598.200	4.373	1.412.807	140.843
	1.885.416	–	931.263	26.298	2.842.977	281.668

Zum 31. Dezember 2022 war der überwiegende Teil der Verbindlichkeiten des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund in US-Dollar denominiert, der funktionalen Währung des Fonds.

[*1] Die Sensitivitätsanalyse zeigt, wie das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen jedes Fonds gestiegen/(gesunken) wäre, hätte der Wechselkurs zwischen dem US-Dollar und der jeweiligen Währung um 10 % höher/(niedriger) gelegen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Forts.)

Konzentration der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten (Fortsetzung)

Finanzielle Vermögenswerte – Angaben in EUR

Zum 31. Dezember 2022 waren der Großteil der Vermögenswerte des Loomis Sayles Euro High Yield Fund, des Loomis Sayles Euro Credit Fund und des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund sowie der Großteil ihrer Verbindlichkeiten in EUR denominiert, der funktionalen Währung der Fonds.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko

Die verzinslichen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Fonds bergen das Risiko, dass sich Schwankungen der aktuellen Marktzinssätze auf die Finanzlage und Cashflows der Fonds auswirken.

Das Zinsrisiko wird zum Teil durch den Prozess der Titelauswahl des Portfolioverwalters gesteuert, im Rahmen dessen Prognosen über zukünftige Ereignisse und ihre Auswirkungen auf Zinsen, die Diversifikation und die Duration erstellt werden. Die Kurse der Wertpapiere im Portfolio der Fonds können von Zinsschwankungen beeinflusst werden. Unerwartete Zinsschwankungen könnten dazu führen, dass sich die Kurse der Positionen der Fonds in eine ursprünglich nicht erwartete Richtung bewegen.

Die folgenden Tabellen fassen das Zinsrisiko der Fonds zusammen. Sie enthalten die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Handelspassiva der Fonds, die nach vertraglich festgelegtem Fälligkeits- bzw. Zinsanpassungstermin gegliedert sind (je nachdem, welcher Termin früher liegt).

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	2.877.638	28.324.486	151.053.486	319.560.908	39.193.509	541.010.027
	2.877.638	28.324.486	151.053.486	319.560.908	39.193.509	541.010.027
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(5.208.855)	(5.208.855)
	–	–	–	–	(5.208.855)	(5.208.855)
Sensitivitätsanalyse						27.062.831

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	123.308	39.422	2.640.050	3.560.283	397.562	6.760.625
	123.308	39.422	2.640.050	3.560.283	397.562	6.760.625
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(46.208)	(46.208)
	–	–	–	–	(46.208)	(46.208)
Sensitivitätsanalyse						2.489

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	170.661	734.949	3.939.189	10.598.364	93.017	15.536.180
	170.661	734.949	3.939.189	10.598.364	93.017	15.536.180
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(85.932)	(85.932)
	–	–	–	–	(85.932)	(85.932)
Sensitivitätsanalyse						999.138

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.140.595	2.330.872	739.043	3.359.374	12.346.776	23.916.660
	5.140.595	2.330.872	739.043	3.359.374	12.346.776	23.916.660
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	(50.666)	–	(1.482.289)	(1.532.955)
	–	–	(50.666)	–	(1.482.289)	(1.532.955)
Sensitivitätsanalyse						233.892

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	398.416	484.211	13.534.004	11.946.821	4.751.618	31.115.070
	398.416	484.211	13.534.004	11.946.821	4.751.618	31.115.070
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–	–
Sensitivitätsanalyse						338.316

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	2.674.511	52.436.166	61.510.734	4.928.451	121.549.862
	–	2.674.511	52.436.166	61.510.734	4.928.451	121.549.862
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(173.427)	(173.427)
	–	–	–	–	(173.427)	(173.427)
Sensitivitätsanalyse						5.325.172

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

31. Dezember 2023	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	10.037.499	360.159.427	445.687.562	26.839.775	842.724.263
	–	10.037.499	360.159.427	445.687.562	26.839.775	842.724.263
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(1.293.600)	(1.293.600)
	–	–	–	–	(1.293.600)	(1.293.600)
Sensitivitätsanalyse						37.363.401

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	60.373.614	46.116.807	165.350.744	279.632.445	32.180.043	583.653.653
	60.373.614	46.116.807	165.350.744	279.632.445	32.180.043	583.653.653
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(573.309)	(573.309)
	–	–	–	–	(573.309)	(573.309)
Sensitivitätsanalyse						26.663.514

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	402.943	151.688	3.555.836	3.976.257	420.243	8.506.967
	402.943	151.688	3.555.836	3.976.257	420.243	8.506.967
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(188)	(188)
	–	–	–	–	(188)	(188)
Sensitivitätsanalyse						3.103

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	263.782	2.093.769	21.190.222	33.489.881	1.164.508	58.202.162
	263.782	2.093.769	21.190.222	33.489.881	1.164.508	58.202.162
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(1.026.200)	(1.026.200)
	–	–	–	–	(1.026.200)	(1.026.200)
Sensitivitätsanalyse						3.688.331

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate USD	3 Monate - 1 Jahr USD	1-5 Jahre USD	> 5 Jahre USD	Zinslos USD	Gesamt USD
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	5.030.721	255.033	52.087	3.057.983	12.412.521	20.808.345
	5.030.721	255.033	52.087	3.057.983	12.412.521	20.808.345
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	(7.133)	–	(580.724)	(587.857)
	–	–	(7.133)	–	(580.724)	(587.857)
Sensitivitätsanalyse						259.381

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	296.391	137.321	9.281.311	11.067.245	5.237.981	26.020.249
	296.391	137.321	9.281.311	11.067.245	5.237.981	26.020.249
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(61.116)	(61.116)
	–	–	–	–	(61.116)	(61.116)
Sensitivitätsanalyse						819.977

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	295.336	3.363.249	45.543.886	46.097.909	4.291.498	99.591.878
	295.336	3.363.249	45.543.886	46.097.909	4.291.498	99.591.878
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	–	–	(369.193)	(369.193)
	–	–	–	–	(369.193)	(369.193)
Sensitivitätsanalyse						4.210.782

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Zinsrisiko (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

31. Dezember 2022	1-3 Monate EUR	3 Monate - 1 Jahr EUR	1-5 Jahre EUR	> 5 Jahre EUR	Zinslos EUR	Gesamt EUR
Vermögenswerte						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte	–	12.690.489	161.628.307	200.903.514	13.573.725	388.796.035
	–	12.690.489	161.628.307	200.903.514	13.573.725	388.796.035
Verbindlichkeiten						
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten	–	–	(3.149)	–	(1.050.298)	(1.053.447)
	–	–	(3.149)	–	(1.050.298)	(1.053.447)
Sensitivitätsanalyse						16.698.394

Alle anderen finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten sind entweder zinslos oder innerhalb eines Monats fällig.

Die Sensitivitätsanalyse zeigt, wie das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen jedes Fonds gestiegen/(gesunken) wäre, hätten die Zinsen um 100 Basispunkte höher/(niedriger) gelegen.

Die allgemeine Zinssensitivität der Fonds wird wöchentlich vom Portfolioverwalter kontrolliert. Probleme in diesem Bereich werden dem Verwaltungsrat in schwerwiegenden Fällen unverzüglich gemeldet. Ansonsten werden sie regelmäßig auf den Sitzungen des Verwaltungsrats besprochen.

Derivatrisiko

Die Fonds handeln mit Finanzinstrumenten und gehen dabei Positionen in börsengehandelten sowie außerbörslich gehandelten Instrumenten (Over-the-Counter-Instrumente) – darunter auch Derivate – ein. Am 31. Dezember 2023 umfassten die von den Fonds eingesetzten Derivate Devisenterminkontrakte, Futures und Swaps (31. Dezember 2022: Devisenterminkontrakte, Futures und Swaps).

Alle angemessenen Kontrollen, die gemäß den OGAW-Verordnungen der Zentralbank über das globale Engagement der Fonds relevant sind, werden für den Commitment-Ansatz an BBH delegiert und intern beim Portfolioverwalter für den absoluten Value-at-Risk (VaR)-Ansatz* durchgeführt. Das globale Marktengagement für Teilfonds, die nach dem Commitment-Ansatz bewertet werden, ist auf 100 % des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds begrenzt. Das globale Marktengagement für Teilfonds, die nach dem absoluten VaR-Ansatz bewertet werden, ist auf 20 % des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds begrenzt. Individuelle Positionsrisiken und das Gesamtrisiko werden jeweils täglich von einem darauf spezialisierten Kontrollteam überwacht. Die Ergebnisse werden vom Portfolioverwalter überwacht. Der Einsatz von Derivaten mit Barausgleich wird jederzeit vollständig durch liquide Mittel oder andere liquide Wertpapiere abgedeckt. Derivate, bei denen eine physische Lieferung erfolgt, werden durch den Basiswert abgesichert. Derivate können zur Absicherung, zur effizienten Portfolioverwaltung und zu Anlagezwecken eingesetzt werden.

Das globale Marktrisiko der Teilfonds für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 wurde anhand des Commitment-Ansatzes berechnet, außer beim Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund, bei dem der VaR-Ansatz angewendet wurde.

Für Teilfonds, für die ein Commitment-Ansatz gilt, betrugen die Beträge der Verpflichtungen zum 31. Dezember 2023 für den Loomis Sayles Multisector Income Fund, den Loomis Sayles High Income Fund, den Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, den Loomis Sayles Euro High Yield Fund, den Loomis Sayles Euro Credit Fund und den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund 19,55 %, 0,86 %, 9,41 %, 5,24 %, 16,96 % bzw. 19,38 % des Gesamtvermögens (31. Dezember 2022: 3,78 %, 0,99 %, 13,57 %, 9,08 % 5,59 % bzw. 5,47 %). Probleme sind dem Verwaltungsrat je nach Bedeutung des Problems so früh wie möglich zu melden (falls erforderlich auch unverzüglich). Bei Währungssicherungsgeschäften prüfen die Portfoliomanager und die Portfoliospezialisten regelmäßig die abgesicherte Position, um festzustellen, ob sie sich weiter im Rahmen der Veränderungen des Basiswerts bewegt.

* Mit dem absoluten VaR-Ansatz wird geschätzt, welcher Verlust innerhalb eines bestimmten Zeithorizontes bei vorgegebenem Konfidenzintervall maximal entstehen kann.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Derivatrisiko (Fortsetzung)

Bei dem nach dem VAR-Ansatz bewerteten Teilfonds ist das für die Berechnung des täglichen absoluten VaR verwendete Modell ein historisches Modell, das auf einem 99%igen Konfidenzniveau für eine Haltezeit von 20 Tagen und einem Beobachtungszeitraum von 500 Tagen basiert. Vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023 betrug der niedrige, der hohe und der durchschnittliche monatliche VaR des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund auf Grundlage des internen Modells von Natixis Investment Managers 1,92 %, 4,57 % bzw. 3,10 % (vom 1. Januar 2022 bis 31. Dezember 2022: 1,24 %, 9,18 % bzw. 3,18 %). Daneben setzt der Portfolioverwalter bei der Verwaltung der Strategie des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund keine Bankkredite ein. Der Einsatz von Derivaten führt jedoch zu einer Hebelwirkung. Die Höhe des Hebels ergibt sich aus der Summe der Nominalbeträge der eingesetzten Derivate. Daher betrug die Hebelwirkung für die Strategie vom 1. Januar 2023 zum 31. Dezember 2023 basierend auf den täglichen Inputdaten durchschnittlich 485,46 % ihres Nettovermögens (vom 1. Januar 2022 zum 31. Dezember 2022: 377,18 %) Probleme sind dem Verwaltungsrat je nach Bedeutung des Problems so früh wie möglich zu melden (falls erforderlich auch unverzüglich).

Außerdem überprüft der Derivatausschuss des Portfolioverwalters sämtliche Aspekte der vorgeschlagenen Derivattransaktionen, wobei ein besonderer Schwerpunkt auf das Risikomanagement gelegt wird. Darüber hinaus ist der Ausschuss dafür verantwortlich, dass alle Probleme in Bezug auf den Handel, die Berichterstattung, operative Fragen, die Preisfindung sowie alle rechtlichen und Compliance-Probleme geklärt sind, bevor der Risikomanagementausschuss den Einsatz einer neuen Derivatstrategie genehmigt. Der Derivatausschuss besteht aus Vertretern der Unternehmensleitung sowie der Bereiche Aktien- und Anleihenportfoliomanagement, Handel, Operations, Recht und Compliance, Technologie und Kundenbetreuung. Die Schlussfolgerungen des Ausschusses werden dem Verwaltungsrat des Portfolioverwalters zur Genehmigung vorgelegt.

Bonitätsrisiko

Die Gesellschaft geht Bonitätsrisiken ein, also das Risiko, dass eine Gegenpartei nicht in der Lage ist, fällige Beträge in voller Höhe zu bezahlen.

Das Bonitätsrisiko wird zum Teil durch bestimmte Anlagerestriktionen der Fonds begrenzt. So dürfen die einzelnen Fonds unter anderem vorbehaltlich anderer Bestimmungen im Prospekt der Gesellschaft maximal 10 % des Nettovermögens in übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente desselben Emittenten anlegen. Darüber hinaus ist der Gesamtwert an übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten von Emittenten, in die ein Fonds mehr als 5 % investiert, auf weniger als 40 % beschränkt.

Liquide Mittel auf Konten bei Brown Brothers Harriman & Co. („BBH“) sind Verbindlichkeiten von BBH, während liquide Mittel auf Konten, die direkt bei externen Korrespondenzbanken, Unterdepotbanken oder Brokern eröffnet wurden (im Folgenden gesamtheitlich als „Agency-Konten“ bezeichnet) Verbindlichkeiten des jeweiligen Agenten darstellen. Liquide Mittel auf Agency-Cash-Konten sind Verbindlichkeiten des jeweiligen Agenten, aus denen eine unmittelbare Schuldner-Gläubiger-Beziehung zwischen dem Agenten und der Gesellschaft erwächst.

Folglich ist BBH zwar dafür verantwortlich, die Agency-Cash-Konten, für die er den Agenten ernannt hat (d.h. im Fall von Korrespondenzbanken und Unterdepotbanken) mit der angemessenen Sorgfalt zu verwalten, haftet jedoch nicht für ihre Rückzahlung, falls der jeweilige Agent wegen eines Konkurses, einer Insolvenz oder aus anderen Gründen die Rückzahlung nicht vornimmt.

Die Barmittel des Fonds werden jede Nacht auf zuvor genehmigte Finanzinstitute übertragen. Zum 31. Dezember 2023 wurden die Barmittel der Fonds auf den nachstehend zusammen mit ihrem jeweiligen Bonitätsrating zu diesem Datum aufgeführten Finanzinstituten gehalten:

Finanzinstitut	Kurzfristiges Bonitätsrating
Brown Brothers Harriman & Co.	High Grade
Australia and New Zealand Banking Group, London	Upper Medium Grade
BNP Paribas, Paris	High Grade
DNB ASA, Oslo, Norwegen	High Grade
DBS Bank Limited	High Grade
HSBC, Hongkong	High Grade
HSBC, London, England	High Grade
JPMorgan Chase & Co.	High Grade
Royal Bank of Canada, Toronto	High Grade
Skandinaviska Enskilda Banken AB	High Grade
Standard Chartered PLC	Upper Medium Grade
Sumitomo Mitsui Banking Corporation	Upper Medium Grade

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022 wurden die Barmittel der Fonds auf den nachstehend zusammen mit ihrem jeweiligen Bonitätsrating zu diesem Datum aufgeführten Finanzinstituten gehalten:

Finanzinstitut	Kurzfristiges Bonitätsrating
Brown Brothers Harriman & Co.	High Grade
Australia and New Zealand Banking Group, London	High Grade
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, Madrid	Upper Medium Grade
BNP Paribas, Paris	High Grade
Credit Suisse Group AG	Upper Medium Grade
HSBC, Hongkong	High Grade
JPMorgan Chase & Co.	High Grade
MUFG Bank, Tokio	High Grade
Royal Bank of Canada, Toronto	High Grade
Skandinaviska Enskilda Banken AB	High Grade
Standard Chartered PLC	High Grade
Sumitomo Mitsui Banking Corporation	High Grade

High Grade – ein mit „High Grade“ bewerteter Schuldner verfügt über eine starke Kapazität zur Erfüllung seiner finanziellen Verpflichtungen.

Upper Medium Grade – ein mit „Upper Medium Grade“ bewerteter Schuldner verfügt über eine zufriedenstellende Kapazität zur Erfüllung seiner finanziellen Verpflichtungen.

Lower Medium Grade – ein mit „Lower Medium Grade“ bewerteter Schuldner verfügt über eine angemessene Kapazität zur Erfüllung seiner finanziellen Verpflichtungen.

Die Verwahrstelle hat zu gewährleisten, dass die verwahrten Vermögenswerte, die nicht zu den Barmitteln zählen, rechtlich getrennt und auf treuhänderischer Basis verwahrt werden und dass geeignete interne Kontrollsysteme existieren, damit ihre Aufzeichnungen die Art und den Betrag aller verwahrten Vermögenswerte eindeutig kennzeichnen. Als Verwahrstelle muss Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited („BBHTS") das Eigentum aller Vermögenswerte und die Lokalisierung der Dokumente, die das Eigentum des jeweiligen Vermögenswerts verbriefen, gewährleisten.

Alle von BBH (als globaler Unterdepotbank im Namen und Auftrag von BBHTS für die zugrunde liegenden Kunden) verwahrten Vermögenswerte sind vom BBH-Vermögen getrennt; dies gilt unabhängig davon, ob sie in den Tresorräumen von BBH, auf getrennten Konten in den Geschäftsbüchern der Unterdepotbanken oder auf einem Konto einer Wertpapiersammelbank gehalten werden. BBH führt in seinen eigenen Geschäftsbüchern und in den Geschäftsbüchern der Unterdepotbank am lokalen Markt, sofern dies möglich ist, für jeden Kunden ein separates Konto. Als Verwahrstelle hat BBHTS auch zu gewährleisten, dass die Vermögenswerte, die nicht zu den Barmitteln zählen, im Netz globaler Unterdepotbanken von BBH auf treuhänderischer Basis verwahrt werden. Die Unterdepotbanken von BBH sind durch Verträge mit BBH und gesetzlich verpflichtet, die von ihnen verwahrten Wertpapiere der Kunden von den allgemeinen Bankvermögen der Unterdepotbanken getrennt zu halten.

BBH führt sowohl einführend als auch fortwährend Due-Diligence-Prüfungen über die Unter-Depotstellen in ihrem globalen Treuhändernetzwerk über ihre Network Management-Gruppe durch. Diese Prüfungen umfassen eine Beurteilung der Serviceniveaustandards, Managementexpertise, Marktinformationen, Depotabläufe, Berichterstellungs- und Technologiefunktionen der Sub-Depotbank sowie der Prüfungen bezüglich der Reputation und des Ansehens im Markt und der fortwährenden Verpflichtung auf die Bereitstellung von Depotdiensten.

Mit allen Unterdepotbanken wurden Service Level Agreements sowie die üblichen vertraglichen Vereinbarungen abgeschlossen, die auf regelmäßigen Sitzungen zur Dienstleistungskontrolle, einschließlich Due-Diligence-Sitzungen vor Ort, überprüft werden.

Die Risk and Credit Group von BBH führt regelmäßig Finanzanalysen aller Unterdepotbanken durch und beurteilt dabei als wesentliche Indikatoren unter anderem die Kapitaladäquanz, die Qualität der Aktiva, die Gewinne, die Liquidität und die Bonitätsratings der jeweiligen Unterdepotbank. Diese Prüfungen sind Teil der Routinebewertung der Finanzstärke und -position, die die BBH für die einzelnen Unterdepotbanken durchführt.

Da die Gesellschaft außerdem eventuell in Märkten investiert, in denen die Depotbank- bzw. Abrechnungssysteme noch nicht voll entwickelt sind, können die Vermögenswerte der Gesellschaft, die an solchen Märkten gehandelt werden und unter bestimmten Umständen Unterdepotbanken übergeben wurden (in Fällen in denen eine Unterdepotbank benötigt wird), gewissen Risiken ausgesetzt sein. Hierfür übernimmt die Verwahrstelle keine Haftung.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Während die von der Unterdepotbank gehaltenen liquiden Mittel eindeutig als Vermögen der Gesellschaft identifiziert werden können, ist die Gesellschaft bei Finanzinstituten, bei denen sie liquide Mittel unterhält, dem Bonitätsrisiko dieses Instituts ausgesetzt. Im Falle der Insolvenz dieses Finanzinstituts gilt die Gesellschaft als nicht bevorrechtigter Gläubiger des Instituts in Bezug auf ihre liquiden Mittel.

Portfolio nach Ratingstufen

Der Portfolioverwalter der Fonds greift bei der Ermittlung der Kreditqualität der finanziellen Vermögenswerte auf bekannte Ratingagenturen zurück. Vermögenswerte, die kein Rating dieser Agenturen besitzen, werden vom Portfolioverwalter nach einem Verfahren bewertet, das dem einer Ratingagentur entspricht.

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Rating *	**31. Dezember 2023**	**31. Dezember 2022**
AAA	16,07 %	27,32 %
AA	0,00 %	0,94 %
A	8,21 %	7,69 %
BAA	35,22 %	27,75 %
BA	17,64 %	15,35 %
B	7,62 %	7,64 %
CAA + niedriger	3,42 %	1,34 %
Ohne Rating **	11,82 %	11,97 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

Loomis Sayles High Income Fund

Rating *	**31. Dezember 2023**	**31. Dezember 2022**
AAA	1,77 %	9,30 %
AA	0,00 %	0,00 %
A	0,00 %	1,75 %
BAA	3,48 %	7,14 %
BA	33,21 %	28,99 %
B	42,21 %	36,16 %
CAA + niedriger	12,77 %	8,98 %
Ohne Rating **	6,56 %	7,68 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Rating *	**31. Dezember 2023**	**31. Dezember 2022**
AAA	49,80 %	50,36 %
AA	9,14 %	6,43 %
A	14,38 %	14,14 %
BAA	18,22 %	15,14 %
BA	5,06 %	5,25 %
B	0,00 %	0,00 %
CAA + niedriger	0,00 %	0,00 %
Ohne Rating **	3,40 %	8,68 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

* Die Ratings basieren ausschließlich auf der Ratingskala von Moody's, und die Ratings und/oder die Abdeckung der von Moody's bewerteten Vermögenswerte können sich von Jahr zu Jahr ändern.

** Anlagen „ohne Rating“ umfassen Barmittel, Aktien und Schuldtitel. * Um die Bonität von zugrunde liegenden Schuldtiteln „ohne Rating“ zu beurteilen, erstellt der Portfolioverwalter auf der Grundlage von internem Research seine eigenen Schattenratings für die einzelnen Schuldinstrumente, für die keine öffentlich zugänglichen Kreditratings zur Verfügung stehen. Der Portfolioverwalter überprüft die wesentlichen Finanzkennzahlen des Wertpapiers und die strukturellen Merkmale der Schuldinstrumente, um für jede entsprechende Anlage ein implizites Rating zu ermitteln. Die Mehrzahl der Schuldverschreibungen ohne Rating verfügt nach Einschätzung des Portfolioverwalters über eine ähnliche Bonität wie Wertpapiere mit einem Rating von BBB/Baa. BBB/Baa ist die niedrigste Ratingstufe, auf der eine Anleihe noch dem Investment-Grade-Segment zugerechnet werden kann. Eine Investment-Grade-Anleihe ist eine Anleihe, deren Ausfallrisiko als relativ niedrig eingeschätzt wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio nach Ratingstufen (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

Rating *	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
AAA	24,38 %	30,97 %
AA	0,00 %	0,50 %
A	3,70 %	1,28 %
BAA	7,02 %	7,57 %
BA	2,19 %	3,36 %
B	0,01 %	2,17 %
CAA + niedriger	0,00 %	1,02 %
Ohne Rating **	62,70 %	53,13 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Rating *	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
AAA	0,00 %	0,00 %
AA	0,00 %	0,00 %
A	1,32 %	1,67 %
BAA	14,65 %	13,88 %
BA	53,65 %	49,69 %
B	2,25 %	4,67 %
CAA + niedriger	0,00 %	0,00 %
Ohne Rating **	28,13 %	30,09 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Rating *	31. Dezember 2023	31. Dezember 2022
AAA	2,79 %	1,46 %
AA	6,65 %	4,59 %
A	36,12 %	31,09 %
BAA	33,31 %	37,13 %
BA	1,79 %	1,76 %
B	0,00 %	0,00 %
CAA + niedriger	0,00 %	0,00 %
Ohne Rating **	19,34 %	23,97 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

* Die Ratings basieren ausschließlich auf der Ratingskala von Moody's, und die Ratings und/oder die Abdeckung der von Moody's bewerteten Vermögenswerte können sich von Jahr zu Jahr ändern.

** Anlagen „ohne Rating“ umfassen Barmittel, Aktien und Schuldtitel. * Um die Bonität von zugrunde liegenden Schuldtiteln „ohne Rating“ zu beurteilen, erstellt der Portfolioverwalter auf der Grundlage von internem Research seine eigenen Schattenratings für die einzelnen Schuldinstrumente, für die keine öffentlich zugänglichen Kreditratings zur Verfügung stehen. Der Portfolioverwalter überprüft die wesentlichen Finanzkennzahlen des Wertpapiers und die strukturellen Merkmale der Schuldinstrumente, um für jede entsprechende Anlage ein implizites Rating zu ermitteln. Die Mehrzahl der Schuldverschreibungen ohne Rating verfügt nach Einschätzung des Portfolioverwalters über eine ähnliche Bonität wie Wertpapiere mit einem Rating von BBB/Baa. BBB/Baa ist die niedrigste Ratingstufe, auf der eine Anleihe noch dem Investment-Grade-Segment zugerechnet werden kann. Eine Investment-Grade-Anleihe ist eine Anleihe, deren Ausfallrisiko als relativ niedrig eingeschätzt wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio nach Ratingstufen (Fortsetzung)

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Rating *	**31. Dezember 2023**	**31. Dezember 2022**
AAA	2,23 %	2,38 %
AA	5,57 %	4,62 %
A	34,21 %	29,43 %
BAA	33,88 %	38,34 %
BA	1,73 %	2,23 %
B	0,00 %	0,00 %
CAA + niedriger	0,00 %	0,00 %
Ohne Rating **	22,38 %	23,00 %
Summe	**100,00 %**	**100,00 %**

* Die Ratings basieren ausschließlich auf der Ratingskala von Moody's, und die Ratings und/oder die Abdeckung der von Moody's bewerteten Vermögenswerte können sich von Jahr zu Jahr ändern.

** Anlagen „ohne Rating“ umfassen Barmittel, Aktien und Schuldtitel. * Um die Bonität von zugrunde liegenden Schuldtiteln „ohne Rating“ zu beurteilen, erstellt der Portfolioverwalter auf der Grundlage von internem Research seine eigenen Schattenratings für die einzelnen Schuldinstrumente, für die keine öffentlich zugänglichen Kreditratings zur Verfügung stehen. Der Portfolioverwalter überprüft die wesentlichen Finanzkennzahlen des Wertpapiers und die strukturellen Merkmale der Schuldinstrumente, um für jede entsprechende Anlage ein implizites Rating zu ermitteln. Die Mehrzahl der Schuldverschreibungen ohne Rating verfügt nach Einschätzung des beauftragten Portfolioverwalters über eine ähnliche Bonität wie Wertpapiere mit einem Rating von BBB/Baa. BBB/Baa ist die niedrigste Ratingstufe, auf der eine Anleihe noch dem Investment-Grade-Segment zugerechnet werden kann. Eine Investment-Grade-Anleihe ist eine Anleihe, deren Ausfallrisiko als relativ niedrig eingeschätzt wird.

Sämtliche Transaktionen in börsennotierten Wertpapieren werden bei Lieferung mithilfe genehmigter Broker abgerechnet/bezahlt. Das Ausfallrisiko ist hierbei als minimal anzusehen, da die Lieferung verkaufter Wertpapiere erst erfolgt, nachdem der Broker die entsprechende Zahlung erhalten hat. Käufe werden erst nach Erhalt der entsprechenden Wertpapiere durch den Broker bezahlt. Kommt eine der Parteien ihren Verpflichtungen im Rahmen des Geschäfts nicht nach, kommt die Transaktion nicht zustande.

Um das Bonitätsrisiko weiter zu minimieren, lässt der Portfolioverwalter die Währungsabsicherung in der Regel von der Verwahrstelle der Fonds ausführen, sodass er günstige Kurse und eine günstige Ausführung erreicht. Darüber hinaus arbeitet der Portfolioverwalter mit großen und bekannten Finanzinstituten (fast immer Banken) mit hoher Bonität zusammen, um sich vorteilhafte Kurse zu sichern. Daher wird das Kontrahentenrisiko bei Währungssicherungsgeschäften als unerheblich angesehen.

Im Einklang mit den Kontrahentenrisikogrundsätzen des Portfolioverwalters versucht der Portfolioverwalter, das Bonitätsrisiko folgendermaßen zu reduzieren:

- Er hat Grundsätze und Verfahrensweisen für Kontrahentenrisiken bei Derivattransaktionen eingeführt, mit deren Hilfe er soweit möglich das Kontrahentenrisiko in Verbindung mit Transaktionen überwacht, steuert und reduziert.
- Der Portfolioverwalter führt keine Kontrahentenrisiko-Transaktionen für ein Mandatmit Kontrahenten durch, die nicht auf der Liste der zugelassenen Derivatekontrahenten der Handelsabteilung erscheinen, die für den Handel im Rahmen dieses Mandats verantwortlich ist.
- Um in die Liste der zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte aufgenommen zu werden, muss ein Kontrahent über ein Bonitätsrating von Baa3 von Moody’s und BBB- von Standard & Poor’s verfügen. Falls der Kontrahent unterschiedliche Ratings aufweist, wird das jeweils niedrigere Rating berücksichtigt.
- Nicht nur das Bonitätsrating eines Kontrahenten gibt Hinweise auf das mit diesem Kontrahenten verbundene Risiko. Jeder Kontrahent muss zwar die Mindestanforderungen an das Bonitätsrating erfüllen. Der Spread eines fünfjährigen Credit Default Swaps (CDS) für einen Kontrahenten stellt jedoch, sofern er verfügbar ist, ebenfalls ein sehr gutes Maß für das Marktrisiko dar, das am Markt mit diesem Kontrahenten assoziiert wird. Wenn der Spread eines fünfjährigen CDS für einen Kontrahenten mindestens 350 Basispunkte beträgt, wird dieser Kontrahent daher auf die Watch-Liste gesetzt und der Ausschuss für das Kontrahentenrisiko des Portfolioverwalters (der „Ausschuss“) prüft das erforderliche Verfahren. Beträgt der Spread eines fünfjährigen CDS für diesen Kontrahenten mindestens 500 Basispunkte, unterzieht der Ausschuss diesen Kontrahenten einer formalen Überprüfung und legt fest, welche der nachfolgend erörterten Schritte zu ergreifen sind.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Währungsrisiko (Fortsetzung)

Portfolio nach Ratingstufen (Fortsetzung)

- Wenn ein Kontrahent nicht mehr das für den Status als zugelassener Kontrahent für Derivatgeschäfte erforderliche Mindestbonitätsrating aufweist oder auf der Grundlage seines fünfjährigen CDS-Spread (sofern verfügbar) anderweitig als riskant gilt, legt der Ausschuss für das Kontrahentenrisiko geeignete Maßnahmen für die weitere Vorgehensweise fest. Zu diesen Maßnahmen gehören unter anderem:
  - teilweise oder vollständige Aussetzung des Handels mit diesem Kontrahenten;
  - Streichung des Kontrahenten von der Liste der zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte und/oder
  - Glattstellung oder Übertragung der noch nicht abgewickelten Geschäfte mit dem Kontrahenten.
- Der Ausschuss erhält täglich Berichte über den nicht realisierten Gesamtgewinn aus nicht abgewickelten Transaktionen mit Kontrahentenrisiko, die mit zugelassenen Kontrahenten getätigt wurden. Die Researchabteilung des Portfolioverwalters für festverzinsliche Wertpapiere überprüft regelmäßig die Bonität sämtlicher Kontrahenten auf der Liste der zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte und informiert den Leiter der Handelsabteilung, den Chief Compliance Officer und den Ausschuss bei Problemen hinsichtlich der Bonität dieser Kontrahenten. Darüber hinaus stellt unsere Handelsabteilung für festverzinsliche Wertpapiere dem Ausschuss wöchentlich Berichte über die Spreads für fünfjährige CDS aller zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte zur Verfügung, soweit diese verfügbar sind. Zusätzlich zur Überprüfung der täglichen Berichte zum Kontrahentenrisiko tritt der Ausschuss mindestens vierteljährlich und bei gegebenem Anlass zusammen, um das Kontrahentenrisiko zu prüfen.
- Um das Kontrahentenrisiko weiter zu reduzieren, schließt der Portfolioverwalter soweit möglich im Namen vieler ihrer Kunden mit ihren zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte Rahmenverträge gemäß den Standards der International Swaps and Derivatives Association (ISDA) ab. Die ISDA-Verträge spezifizieren die vereinbarten Bedingungen für die in ihrem Rahmen abgeschlossenen Geschäfte und regeln die Übertragung von Sicherheiten von einem zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte auf die Verwahrstelle eines Kunden, sofern sich eine Transaktion mit Kontrahentenrisiko „im Geld“ befindet. Im umgekehrten Fall sieht ein ISDA-Vertrag die Übertragung von Sicherheiten vom Depot eines Kunden auf den zugelassenen Kontrahenten für Derivatgeschäfte vor, wenn eine Anlage eine Verlustposition aufweist. Der ISDA-Vertrag ermöglicht zudem die Aufrechnung der einer Vertragspartei geschuldeten Beträge mit den von dieser Partei zu zahlenden Beträgen und gewährleistet dadurch einen effizienten Kapitaleinsatz. Die erforderliche Stellung von Sicherheiten eines Kontrahenten bei der Verwahrstelle eines Kunden in Höhe des Betrags, in dem sich der entsprechende Kontrakt „im Geld“ befindet, reduziert das Bonitätsrisiko gegenüber diesem Kontrahenten, da der Kunde bei einem Ausfall des Kontrahenten die geleisteten Sicherheiten in Besitz nehmen kann.
- Die Verhandlung und der Abschluss von ISDA-Verträgen sind ein langwieriger Prozess. Nicht für alle Kontrahenten wurden ISDA-Verträge abgeschlossen; der Portfolioverwalter bemüht sich jedoch nach wie vor um ihren Abschluss, wo immer dies möglich ist.
- Anträge auf Aufnahme eines neuen Kontrahenten für Derivatgeschäfte oder Änderungen in Bezug auf bestehende Kontrahenten sind vorab vom Leiter der Handelsabteilung und dem Chief Compliance Officer über das System zur automatisierten Genehmigung von Brokern und Händlern zu genehmigen und dem Portfolioverwalter mitzuteilen, soweit sie die Gesellschaft betreffen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko

Liquiditätsrisiko ist das Risiko, dass eine Organisation Schwierigkeiten bekommt, ihren Verpflichtungen im Zusammenhang mit finanziellen Verbindlichkeiten nachzukommen. Die Fonds müssen täglich Barzahlungen für die Rücknahme rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile leisten. Die Fonds behalten generell einen bestimmten Teil ihres Vermögens in bar ein, um damit Rücknahmezahlungen tätigen zu können. Darüber hinaus wird gemäß den Bestimmungen des Verkaufsprospekts nur ein begrenzter Teil des Vermögens der Fonds in übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente investiert, die nicht sofort veräußerbar sind. Sollten die Fonds in die Lage kommen, unverzüglich Geld aufnehmen zu müssen, können sie sich die Mittel vorübergehend durch Kreditaufnahme beschaffen, vorausgesetzt, ihr jeweiliges Gesamtkreditvolumen beträgt nicht mehr als 10 % ihres jeweiligen Nettoinventarwerts.

Das Liquiditätsrisiko wird auch durch Vorschriften gesteuert, die den Verwaltungsrat ermächtigen, unter bestimmten Umständen Rücknahmen zu begrenzen oder ganz auszusetzen. Dies ist unter anderem dann möglich, wenn das Gesamtvolumen der Rücknahmeanträge für einen Teilfonds an einem Tag den Wert von 10 % seiner insgesamt umlaufenden Anzahl von rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen übersteigt. Der Verwaltungsrat hat diese Maßnahme seit der Auflegung bei keinem Fonds ergriffen.

Der Portfolioverwalter hat eigene Liquiditätmanagementsysteme entwickelt bzw. verwendet branchenbezogene Risikomodule, um das Liquiditätsrisiko der Teilfonds zu messen, und trägt dafür Sorge, dass das Liquiditätsprofil der Fondsanlagen den Verpflichtungen des Fonds entspricht, insbesondere dafür, dass der Fonds in der Lage ist, Rücknahmeanträge der Anteilinhaber gemäß den Bestimmungen des Prospekts zu erfüllen.

Für die Fonds werden Liquiditätsrisikoindikatoren wie die Kosten für die Liquidation und die Zeit bis zur Liquidation auf der Grundlage verschiedener Stressmarktszenarien berechnet. Im Rahmen der Analyse des Liquiditätsprofils der Fondsanlagen hat der Portfolioverwalter einige Liquiditätsrisiko-Signale definiert. Die Liquiditäts-Risikoindikatoren werden vom Portfolioverwalter täglich überwacht.

Darüber hinaus überwacht der Portfolioverwalter den Deckungsgrad der Rücknahmen, indem er den liquiden Teil der Fonds (für die Zeit bis zur Liquidierung des Bucketings) mit einer geschätzten Rücknahme belastet, sowie zum Beispiel durch die Überwachung von Liquiditätsengpässen. Diese Überwachung wird durchgeführt, um zu bestätigen, dass die Fonds über ausreichende Liquidität verfügen, um Rücknahmen zu decken.

Kein Anleger hält mehr als 20 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Multisector Income Fund zum 31. Dezember 2023, zwei Anleger halten 56 % des Nettovermögens des Loomis Sayles High Income Fund zum 31. Dezember 2023, zwei Anleger halten 78 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund zum 31. Dezember 2023, ein Anleger hält über 99 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund zum 31. Dezember 2023, zwei Anleger halten 91 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Euro High Yield Fund zum 31. Dezember 2023, zwei Anleger halten 64 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Euro Credit Fund zum 31. Dezember 2023 und kein Anleger hält mehr als 20 % des Nettovermögens des Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund zum 31. Dezember 2023. Weitere Einzelheiten finden Sie in Erläuterung 12 des Abschlusses.

Gegebenenfalls führen der Portfolioverwalter und der Portfolioverwalter ein Liquiditäts-Risikoverfahren auf Basis eines qualitativen Ansatzes ein, um die Liquidität bestimmter Vermögenswerte mit geringerer Liquidität zu bestätigen und nachzuweisen.

Die Liquiditätspositionen der Fonds werden ebenfalls täglich vom Portfolioverwalter kontrolliert. Probleme in diesen Bereichen werden dem Verwaltungsrat in schwerwiegenden Fällen unverzüglich gemeldet. Ansonsten werden sie regelmäßig auf den Sitzungen des Verwaltungsrats besprochen.

Insbesondere in Bezug auf Derivate wird angesichts der Art der in den Fonds eingesetzten Finanzderivate sowie der beteiligten Währungen und der relativ geringen Positionsgrößen von einem geringen Liquiditätsrisiko ausgegangen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	200	–
Abzugrenzender Aufwand	–	1.178.270
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	550.885.411	–
Summe	**550.885.611**	**1.178.270**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	6.620	111.240.230
Forderungen	(6.642)	(112.602.930)
Netto	(22)	(1.362.700)
Summe	**550.885.589**	**(184.430)**

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	5.047	–
Abzugrenzender Aufwand	–	68.032
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	6.840.896	–
Summe	**6.845.943**	**68.032**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	1.915.801	1.877.605
Forderungen	(1.918.656)	(1.918.656)
Netto	(2.855)	(41.051)
Summe	**6.843.088**	**26.981**

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	1	–
Abzugrenzender Aufwand	–	95.370
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	16.062.436	–
Summe	**16.062.437**	**95.370**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	–	1.978.501
Forderungen	–	(2.019.483)
Netto	–	(40.982)
Summe	**16.062.437**	**54.388**

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	95.514
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	28.158.616	–
Summe	**28.158.616**	**95.514**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	33.309.607	27.443.057
Forderungen	(33.450.613)	(28.053.730)
Netto	(141.006)	(610.673)
Summe	**28.017.610**	**(515.159)**

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	101.699
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	32.876.209	–
Summe	**32.876.209**	**101.699**

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	258.222
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	125.061.786	–
Summe	**125.061.786**	**258.222**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	1.333.306	668.822
Forderungen	(1.352.460)	(683.695)
Netto	(19.154)	(14.873)
Summe	**125.042.632**	**243.349**

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	826.943	–
Abzugrenzender Aufwand	–	926.958
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	859.056.503	–
Summe	**859.883.446**	**926.958**

Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile werden auf Anfrage des Anteilinhabers zurückgenommen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	153	–
Abzugrenzender Aufwand	–	865.179
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	594.894.345	–
Summe	**594.894.498**	**865.179**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	46.109.364	–
Forderungen	(46.267.820)	–
Netto	(158.456)	–
Summe	**594.736.042**	**865.179**

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	64.509	–
Abzugrenzender Aufwand	–	140.577
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	8.630.824	–
Summe	**8.695.333**	**140.577**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	1.790.959	–
Forderungen	(1.794.539)	–
Netto	(3.580)	–
Summe	**8.691.753**	**140.577**

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	192.744
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	58.739.770	–
Summe	**58.739.770**	**192.744**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	45.844.298	3.927.393
Forderungen	(46.791.822)	(3.961.744)
Netto	(947.524)	(34.351)
Summe	**57.792.246**	**158.393**

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Liquiditätsrisiko (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Erwerb von Wertpapieren, noch nicht abgerechnet	1.196.875	–
Abzugrenzender Aufwand	–	244.478
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	25.045.099	–
Summe	**26.241.974**	**244.478**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	25.590.433	5.172.924
Forderungen	(25.641.741)	(5.204.243)
Netto	(51.308)	(31.319)
Summe	**26.190.666**	**213.159**

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	123.481
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	27.451.043	–
Summe	**27.451.043**	**123.481**
Devisenterminkontrakte		
Verbindlichkeiten	8.298	–
Forderungen	(8.525)	–
Netto	(227)	–
Summe	**27.450.816**	**123.481**

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	178.615
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	101.677.458	–
Summe	**101.677.458**	**178.615**

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

	weniger als 1 Monat USD	mehr als 1 Monat USD
Abzugrenzender Aufwand	–	374.649
Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile	398.278.134	–
Summe	**398.278.134**	**374.649**

Rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile werden auf Anfrage des Anteilinhabers zurückgenommen.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Kapitalrisikomanagement

Das Kapital des Fonds wird durch das auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallende Nettovermögen repräsentiert. Der Betrag des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens kann von Tag zu Tag stark schwanken, da die Fonds täglich Zeichnungen und Rücknahmen verzeichnen, die im Ermessen der Anteilinhaber liegen; zudem verändert sich der Betrag infolge der Fondsperformance. Bei ihrem Kapitalmanagement verfolgen die Fonds das Ziel, die Unternehmensfortführung sicherzustellen, um Renditen für ihre Anteilinhaber zu erwirtschaften, eine starke Kapitalbasis zu erhalten und somit die Weiterentwicklung der Anlageaktivitäten der Fonds zu unterstützen.

Zur Erhaltung der Kapitalstruktur richten sich die Fonds bei der Anteilsrücknahme und der Ausgabe neuer Anteile nach den Bestimmungen seiner Gründungsunterlagen, die unter anderem die Möglichkeit der Beschränkung von Zeichnungen und Rücknahmen vorsehen.

Der Verwaltungsrat und der Portfolioverwalter richten sich bei der Überwachung des Kapitals nach dem Wert des auf rückzahlbare, gewinnberechtigte Anteile entfallenden Nettovermögens.

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat die zum beizulegenden Zeitwert angesetzten Finanzinstrumente gemäß einer Fair-Value-Hierarchie klassifiziert, die die Bedeutung der bei der Bewertung verwendeten Inputfaktoren widerspiegelt. Die Fair-Value-Hierarchie umfasst die folgenden Stufen:

(i) Stufe 1: Zu den Anlagen, deren Wert auf Marktpreisen an aktiven Märkten beruht und die daher Stufe 1 zugeordnet werden, gehören aktive notierte Aktien, Schatzwechsel der US-Regierung (Treasury Bills) und bestimmte Staatsanleihen anderer Länder als der USA. Die quotierten Preise für diese Instrumente werden nicht angepasst.

(ii) Stufe 2: Finanzinstrumente, die an nicht als aktiv eingestuften Märkten gehandelt werden, die jedoch anhand von quotierten Marktpreisen, Quotierungen von Brokern oder alternativen Preisbildungsquellen bewertet werden, die auf beobachtbaren Inputfaktoren beruhen, werden Stufe 2 zugeordnet. Zu diesen Anlagen zählen Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating und bestimmte Staatsanleihen anderer Länder als der USA, börsennotierte Aktien und außerbörslich gehandelte Derivate. Da die Stufe 2 zugeordneten Instrumente Positionen enthalten, die nicht an aktiven Märkten gehandelt werden und/oder Übertragungsbeschränkungen unterliegen, können die Bewertungen angepasst werden, um die fehlende Liquidität und/oder die Nicht-Übertragbarkeit widerzuspiegeln; Grundlage hierfür bilden im Allgemeinen verfügbare Marktinformationen.

(iii) Stufe 3: Stufe 3 zugeordnete Anlagen enthalten erhebliche nicht beobachtbare Inputfaktoren, da sie selten gehandelt werden. Zu den Instrumenten in Stufe 3 zählen bestimmte Schuldtitel von Unternehmen. Da für diese Wertpapiere keine beobachtbaren Preise zur Verfügung stehen, haben die Fonds zur Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts Bewertungstechniken eingesetzt.

Die Stufe der Fair-Value-Hierarchie, der die Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts als Ganzes zugeordnet wird, ergibt sich aus dem Inputfaktor der niedrigsten Stufe, der für die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eine Rolle spielt. Zu diesem Zweck wird der Stellenwert bestimmt, den ein Inputfaktor für die Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts als Ganzes hat. Wenn bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts beobachtbare Inputfaktoren verwendet werden, die eine erhebliche Anpassung auf der Grundlage nicht beobachtbarer Inputfaktoren erfordern, handelt es sich um eine Bewertung nach Stufe 3. Um den Stellenwert eines bestimmten Inputfaktors für die Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts als Ganzes zu bestimmen, ist ein Urteilsvermögen erforderlich, das die spezifischen Faktoren eines finanziellen Vermögenswerts oder einer finanziellen Verbindlichkeit berücksichtigt.

Die Festlegung, welche Inputfaktoren als „beobachtbar“ gelten, erfordert vom Verwaltungsrat erhebliches Augenmaß. Der Verwaltungsrat hat diese Aufgabe an den Anlagemanager übertragen. Der Anlagemanager erachtet – in Absprache mit der Verwaltungsstelle – diejenigen Marktdaten als beobachtbar, die jederzeit verfügbar sind, regelmäßig veröffentlicht oder aktualisiert werden, zuverlässig und nachvollziehbar sind, keine firmeninternen Daten darstellen und aus unabhängigen Quellen stammen, die an den relevanten Märkten aktiv tätig sind.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	514.013.614	–	514.013.614
Aktien	2.448.769	–	–	2.448.769
Anlagefonds	11.489.676	–	–	11.489.676
Vorzugsaktien	3.005.118	298.595	73.242	3.376.955
Forwards	–	2.478.078	–	2.478.078
Futures	7.202.935	–	–	7.202.935
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(1.369.285)	–	(1.369.285)
Futures	(3.839.570)	–	–	(3.839.570)
Gesamtvermögen	20.306.928	515.421.002	73.242	535.801.172

Die Positionen der Stufe 3 wurden unter Verwendung einer durch einen Makler bereitgestellten Notierung bewertet, die als indikativ für deren jeweilige Marktpreise angesehen wurde, wobei aber jeweils nicht beobachtbare Inputfaktoren bezüglich der Bewertungen angenommen wurden.

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	558.716.897	15.000	558.731.897
Aktien	1.683.996	–	–	1.683.996
Anlagefonds	12.322.566	–	–	12.322.566
Vorzugsaktien	8.248.038	2.502.791	76.582	10.827.411
Forwards	–	87.783	–	87.783
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(78.812)	–	(78.812)
Futures	(494.497)	–	–	(494.497)
Gesamtvermögen	21.760.103	561.228.659	91.582	583.080.344

Die Positionen der Stufe 3 wurden unter Verwendung einer durch einen Makler bereitgestellten Notierung bewertet, die als indikativ für deren jeweilige Marktpreise angesehen wurde, wobei aber jeweils nicht beobachtbare Inputfaktoren bezüglich der Bewertungen angenommen wurden.

Die folgenden Tabellen zeigen die Entwicklung der Stufe 3-Instrumente für die am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Geschäftsjahre, aufgeschlüsselt nach Kategorien von Finanzinstrumenten:

Zum 31. Dezember 2023

	Anleihen	Vorzugsaktien	Summe
Anfangssaldo zum 1. Januar 2023	**15.000**	**76.582**	**91.582**
Käufe	–	–	–
Verkäufe	(110.000)	–	(110.000)
Abgegrenzte Abschläge (Aufschläge)	110.000	–	110.000
Transfers in Stufe 3	–	–	–
Transfers aus Stufe 3	(15.000)	–	(15.000)
Erfolgswirksam verbuchte Gewinne und Verluste	–	(3.340)	(3.340)
Schlusssaldo zum 31. Dezember 2023	**–**	**73.242**	**73.242**
Veränderung des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts für Vermögenswerte der Stufe 3, die sich zum Jahresende im Portfolio befinden, enthalten in der sonstigen Nettoveränderung des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**–**	(3.340)	(3.340)

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022

	Anleihen	Aktien	Vorzugsaktien	Summe
Anfangssaldo zum 1. Januar 2022	**316.596**	**–**	**–**	**316.596**
Käufe	–	–	–	–
Verkäufe	–	–	–	–
Abgegrenzte Abschläge (Aufschläge)	1.254	–	–	1.254
Transfers in Stufe 3	–	–	92.500	92.500
Transfers aus Stufe 3	(298.596)	–	–	(298.596)
Erfolgswirksam verbuchte Gewinne und Verluste	(4.254)	–	(15.918)	(20.172)
Schlusssaldo zum 31. Dezember 2022	**15.000**	**–**	**76.582**	**91.582**
Veränderung des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts für Vermögenswerte der Stufe 3, die sich zum Jahresende im Portfolio befinden, enthalten in der sonstigen Nettoveränderung des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(4.254)	–	(15.918)	(20.172)

Loomis Sayles High Income Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	6.450.801	–	6.450.801
Aktien	1.989	–	–	1.989
Anlagefonds	153.191	–	–	153.191
Vorzugsaktien	20.704	–	44.539	65.243
Forwards	–	89.401	–	89.401
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(46.208)	–	(46.208)
Gesamtvermögen	175.884	6.493.994	44.539	6.714.417

Die Positionen der Stufe 3 wurden unter Verwendung einer durch einen Makler bereitgestellten Notierung bewertet, die als indikativ für deren jeweilige Marktpreise angesehen wurde, wobei aber jeweils nicht beobachtbare Inputfaktoren bezüglich der Bewertungen angenommen wurden.

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	8.159.155	–	8.159.155
Aktien	2.010	–	–	2.010
Anlagefonds	244.197	–	–	244.197
Vorzugsaktien	54.898	–	46.570	101.468
Forwards	–	137	–	137
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(188)	–	(188)
Gesamtvermögen	301.105	8.159.104	46.570	8.506.779

Die Positionen der Stufe 3 wurden unter Verwendung einer durch einen Makler bereitgestellten Notierung bewertet, die als indikativ für deren jeweilige Marktpreise angesehen wurde, wobei aber jeweils nicht beobachtbare Inputfaktoren bezüglich der Bewertungen angenommen wurden.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles High Income Fund (Fortsetzung)

Die folgenden Tabellen zeigen die Entwicklung der Stufe 3-Instrumente für die am 31. Dezember 2023 und am 31. Dezember 2022 abgelaufenen Geschäftsjahre, aufgeschlüsselt nach Kategorien von Finanzinstrumenten:

Zum 31. Dezember 2023

	Anleihen	Vorzugsaktien	Summe
Anfangssaldo zum 1. Januar 2023	**–**	**46.570**	**46.570**
Käufe	–	–	–
Verkäufe	–	–	–
Abgegrenzte Abschläge (Aufschläge)	–	–	–
Transfers in Stufe 3	–	–	–
Transfers aus Stufe 3	–	–	–
Erfolgswirksam verbuchte Gewinne und Verluste	–	(2.031)	(2.031)
Schlusssaldo zum 31. Dezember 2023	**–**	**44.539**	**44.539**
Veränderung des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts für Vermögenswerte der Stufe 3, die sich zum Jahresende im Portfolio befinden, enthalten in der sonstigen Nettoveränderung des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	**–**	(2.031)	(2.031)

Zum 31. Dezember 2022

	Anleihen	Aktien	Summe
Anfangssaldo zum 1. Januar 2022	**28.056**	**–**	**28.056**
Käufe	–	–	–
Verkäufe	–	–	–
Abgegrenzte Abschläge (Aufschläge)	–	–	–
Transfers in Stufe 3	–	56.250	56.250
Transfers aus Stufe 3	(28.056)	–	(28.056)
Erfolgswirksam verbuchte Gewinne und Verluste	–	(9.680)	(9.680)
Schlusssaldo zum 31. Dezember 2022	**–**	**46.570**	**46.570**
Veränderung des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts für Vermögenswerte der Stufe 3, die sich zum Jahresende im Portfolio befinden, enthalten in der sonstigen Nettoveränderung des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	–	(9.680)	(9.680)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	**Stufe 1**	**Stufe 2**	**Stufe 3**	**Summe**
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	15.443.164	–	15.443.164
Forwards	–	41.757	–	41.757
Futures	51.259	–	–	51.259
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(39.221)	–	(39.221)
Futures	(46.711)	–	–	(46.711)
Gesamtvermögen	4.548	15.445.700	–	15.450.248

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	57.217.806	–	57.217.806
Forwards	–	954.115	–	954.115
Futures	30.241	–	–	30.241
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(994.673)	–	(994.673)
Futures	(31.527)	–	–	(31.527)
Gesamtvermögen	(1.286)	57.177.248	–	57.175.962

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gab es beim Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund keine Wertpapiere auf Stufe 3, keine Transfers zwischen den Stufen und keine Übertragungen auf Stufe 3.

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	11.122.279	–	11.122.279
Aktien	10.642.680	–	–	10.642.680
Forwards	–	1.365.366	–	1.365.366
Futures	338.731	–	–	338.731
Credit Default Index Swaps	447.604	–	–	447.604
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(807.681)	–	(807.681)
Futures	(674.607)	–	–	(674.607)
Credit Default Index Swaps	(50.667)	–	–	(50.667)
Gesamtvermögen	10.703.741	11.679.964	–	22.383.705

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	8.372.945	–	8.372.945
Aktien	11.779.840	–	–	11.779.840
Forwards	–	99.072	–	99.072
Futures	533.609	–	–	533.609
Credit Default Index Swaps	–	22.879	–	22.879
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(59.626)	–	(59.626)
Futures	(521.098)	–	–	(521.098)
Credit Default Index Swaps	–	(7.133)	–	(7.133)
Gesamtvermögen	11.792.351	8.428.137	–	20.220.488

Die Positionen der Stufe 3 wurden unter Verwendung einer durch einen Makler bereitgestellten Notierung bewertet, die als indikativ für deren jeweilige Marktpreise angesehen wurde, wobei aber jeweils nicht beobachtbare Inputfaktoren bezüglich der Bewertungen angenommen wurden.

Zum 31. Dezember 2023 gab es beim Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund keine Wertpapiere auf Stufe 3, keine Transfers zwischen den Stufen und keine Übertragungen auf Stufe 3.

Die folgenden Tabellen zeigen die Entwicklung der Stufe-3-Instrumente für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022, aufgeschlüsselt nach Kategorien von Finanzinstrumenten:

Zum 31. Dezember 2022

	Total Return Swaps	Summe
Anfangssaldo zum 1. Januar 2022	**172.851**	**172.851**
Käufe	13.000.000	13.000.000
Verkäufe	(13.040.669)	(13.040.669)
Abgegrenzte Abschläge (Aufschläge)	–	–
Transfers in Stufe 3	–	–
Transfers aus Stufe 3	–	–
Erfolgswirksam verbuchte Gewinne und Verluste	(132.182)	(132.182)
Schlusssaldo zum 31. Dezember 2022	**–**	**–**
Veränderung des nicht realisierten Gewinns oder Verlusts für Vermögenswerte der Stufe 3, die sich zum Jahresende im Portfolio befinden, enthalten in der sonstigen Nettoveränderung des beizulegenden Zeitwerts von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	(172.851)	(172.851)

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	31.101.256	–	31.101.256
Forwards	–	139	–	139
Futures	13.675	–	–	13.675
Gesamtvermögen	13.675	31.101.395	–	31.115.070

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	25.984.449	–	25.984.449
Futures	35.800	–	–	35.800
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(4)	–	(4)
Futures	(61.112)	–	–	(61.112)
Gesamtvermögen	(25.312)	25.984.445	–	25.959.133

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gab es beim Loomis Sayles Euro High Yield Fund keine Wertpapiere auf Stufe 3, keine Transfers zwischen den Stufen und keine Übertragungen auf Stufe 3.

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Die folgenden Tabellen analysieren die Fair-Value-Hierarchie innerhalb der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des Fonds, die zum 31. Dezember 2023 und zum 31. Dezember 2022 mit ihrem beizulegenden Zeitwert angesetzt wurden.

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	121.332.450	–	121.332.450
Forwards	–	19.232	–	19.232
Futures	198.180	–	–	198.180
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Forwards	–	(34.827)	–	(34.827)
Futures	(138.600)	–	–	(138.600)
Gesamtvermögen	59.580	121.316.855	–	121.376.435

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	99.548.918	–	99.548.918
Futures	42.960	–	–	42.960
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures	(369.193)	–	–	(369.193)
Gesamtvermögen	(326.233)	99.548.918	–	99.222.685

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro Credit Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gab es beim Loomis Sayles Euro Credit Fund keine Wertpapiere auf Stufe 3, keine Transfers zwischen den Stufen und keine Übertragungen auf Stufe 3.

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Die folgenden Tabellen schlüsseln zum31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 zu ihrem beizulegenden Zeitwert gemessen werden:

Zum 31. Dezember 2023

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	841.442.328	–	841.442.328
Futures	1.281.935	–	–	1.281.935
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures	(1.293.600)	–	–	(1.293.600)
Gesamtvermögen	(11.665)	841.442.328	–	841.430.663

Zum 31. Dezember 2022

Vermögenswerte	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte:				
Anleihen	–	388.538.295	–	388.538.295
Futures	257.740	–	–	257.740
Verbindlichkeiten				
Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Verbindlichkeiten:				
Futures	(1.050.298)	–	–	(1.050.298)
Credit Default Swaps	–	(3.149)	–	(3.149)
Gesamtvermögen	(792.558)	388.535.146	–	387.742.588

Zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 gab es beim Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund keine Wertpapiere auf Stufe 3, keine Transfers zwischen den Stufen und keine Übertragungen auf Stufe 3

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung

Die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten wurden in der Bilanz in keinem Fall gegeneinander aufgerechnet. Die Angaben in den folgenden Tabellen schließen finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten ein, die Gegenstand eines durchsetzbaren ISDA-Rahmenvertrags sind.

Die ISDA-Globalverrechnungsverträge erfüllen nicht die Kriterien für eine Aufrechnung in der Bilanz, da sie ein Anrecht auf eine Aufrechnung erfasster Beträge schaffen, das nur nach einem Zahlungsausfall, einer Insolvenz oder einem Konkurs der Gesellschaft oder der Kontrahenten durchsetzbar ist. Darüber hinaus beabsichtigen die Gesellschaft und ihre Kontrahenten nicht, die Beträge auf einer Nettobasis gegeneinander aufzurechnen oder die Vermögensgegenstände zu veräußern und die Verbindlichkeiten gleichzeitig abzurechnen.

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	2.478.078	–	2.478.078
	2.478.078	–	2.478.078

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD	Finanzinstrumente USD	Erhaltene Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Brown Brothers Harriman	2.478.078	(1.352.387)	–	1.125.691
Summe	2.478.078	(1.352.387)	–	1.125.691

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD
Devisenterminkontrakte	(1.369.285)	–	(1.369.285)
Summe	(1.369.285)	–	(1.369.285)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD	Finanzinstrumente USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	(16.898)	–	–	(16.898)
Brown Brothers Harriman	(1.352.387)	1.352.387	–	–
Summe	(1.369.285)	1.352.387	–	(16.898)

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund (Fortsetzung)

Alle zum 31. Dezember 2022 bestehenden Derivate wurden mit Brown Brothers Harriman & Co abgeschlossen. Daher können alle Beträge aus Derivatpositionen nur bei einem Zahlungsausfall, einer Insolvenz oder einem Konkurs gegeneinander aufgerechnet werden. Zum 31. Dezember 2022 beliefen sich die Nettoverbindlichkeiten auf USD (78.812)). Weitere Einzelheiten zu den zum 31. Dezember 2023 bestehenden Derivaten entnehmen Sie bitte der Vermögensaufstellung auf den Seiten 131 bis 150.

Loomis Sayles High Income Fund

Alle zum 31. Dezember 2023 bestehenden Derivate wurden mit Brown Brothers Harriman & Co abgeschlossen (31. Dezember 2022: Brown Brothers Harriman & Co). Daher können alle Beträge aus Derivatpositionen nur bei einem Zahlungsausfall, einer Insolvenz oder einem Konkurs gegeneinander aufgerechnet werden. Zum 31. Dezember 2023 beliefen sich die Nettoverbindlichkeiten auf USD (46.208) (31. Dezember 2022: USD (137)). Weitere Einzelheiten zu den zum 31. Dezember 2023 bestehenden Derivaten entnehmen Sie bitte der Vermögensaufstellung auf den Seiten 151 bis 165.

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	41.757	–	41.757
	41.757	–	41.757

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD	Finanzinstrumente USD	Erhaltene Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	30.985	(10.668)	–	20.317
BNP Paribas SA	1.397	(1.397)	–	–
Brown Brothers Harriman	4.860	(627)	–	4.233
Royal Bank of Canada	4.499	–	–	4.499
UBS Securities LLC	16	(16)	–	–
Summe	41.757	(12.708)	–	29.049

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD
Devisenterminkontrakte	(39.221)	–	(39.221)
Summe	(39.221)	–	(39.221)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD	Finanzinstrumente USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	(10.668)	10.668	–	–
Barclays Bank PLC	(865)	–	–	(865)
BNP Paribas SA	(7.869)	1.397	–	(6.472)
Brown Brothers Harriman	(627)	627	–	–
Goldman Sachs	(79)	–	–	(79)
HSBC Bank	(3.463)	–	–	(3.463)
UBS Securities LLC	(15.650)	16	–	(15.634)
Summe	(39.221)	12.708	–	(26.513)

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	954.115	–	954.115
	954.115	–	954.115

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD	Finanzinstrumente USD	Erhaltene Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	184.549	(5.772)	(178.777)	–
Barclays Bank PLC	638	–	–	638
BNP Paribas SA	3.374	–	–	3.374
Brown Brothers Harriman	751.148	(751.148)	–	–
HSBC Bank	2.887	–	–	2.887
UBS Securities LLC	11.519	(11.519)	–	–
Summe	954.115	(768.439)	(178.777)	6.899

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD
Devisenterminkontrakte	(40.558)	–	(40.558)
Summe	(40.558)	–	(40.558)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD	Finanzinstrumente USD	Verpfändete Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	(5.772)	5.772	–	–
Brown Brothers Harriman	(965.318)	751.148	–	(214.170)
UBS Securities LLC	(23.583)	11.519	10.000	(2.064)
Summe	(994.673)	768.439	10.000	(216.234)

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	1.365.366	–	1.365.366
	1.365.366	–	1.365.366

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD	Finanzinstrumente USD	Erhaltene Barsicherheiten USD	Nettobetrag[1] USD
Barclays Bank PLC	28.708	(1.198)	–	27.510
Brown Brothers Harriman	1.328.044	(686.088)	–	641.956
Citibank NA	2.307	–	–	2.307
Goldman Sachs	1.229	(666)	–	563
HSBC Bank	5.078	(5.078)	–	–
Summe	1.365.366	(693.030)	–	672.336

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD
Devisenterminkontrakte	(807.681)	–	(807.681)
Summe	(807.681)	–	(807.681)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD	Finanzinstrumente USD	Geleistete Barsicherheit* USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	(31.830)	–	–	(31.830)
Barclays Bank PLC	(1.198)	1.198	–	–
Brown Brothers Harriman	(686.088)	686,088	–	–
Goldman Sachs	(666)	666	–	–
HSBC Bank	(18.422)	5,078	–	(13.344)
Morgan Stanley Capital	(23.577)	–	23.577	–
UBS Securities LLC	(45.900)	–	–	(45.900)
Summe	(807.681)	693.030	23.577	(91.074)

*Die tatsächlich verpfändeten Sicherheiten können größer sein, als in der vorstehenden Tabelle angegeben.
[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	99.072	–	99.072
	99.072	–	99.072

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD	Finanzinstrumente USD	Erhaltene Barsicherheiten* USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	39.165	(8.435)	–	30.730
Barclays Bank PLC	22.761	–	–	22.761
Brown Brothers Harriman	1.513	(1.513)	–	–
Citibank NA	51	(26)	(25)	–
HSBC Bank	6.032	(6.032)	–	–
UBS Securities LLC	29.550	(29.550)	–	–
Summe	99.072	(45.556)	(25)	53.491

* Die tatsächlich erhaltenen Sicherheiten können höher sein, als in der vorstehenden Tabelle angegeben.
[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund (Fortsetzung)

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Vermögenswerte und Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte USD	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge USD	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte USD
Devisenterminkontrakte	(59.626)	–	(59.626)
Summe	(59.626)	–	(59.626)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten USD	Finanzinstrumente USD	Geleistete Barsicherheit* USD	Nettobetrag[1] USD
Bank of America	(8.435)	8.435	–	–
Brown Brothers Harriman	(2.858)	1.513	–	(1.345)
Citibank NA	(26)	26	–	–
HSBC Bank	(11.873)	6.032	–	(5.841)
Morgan Stanley Capital	(3.395)	–	3.395	–
UBS Securities LLC	(33.039)	29.550	–	(3.489)
Summe	(59.626)	45.556	3.395	(10.675)

*Die tatsächlich verpfändeten Sicherheiten können größer sein, als in der vorstehenden Tabelle angegeben.
[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Zum 31. Dezember 2023 hielt der Fonds die folgenden derivativen Vermögenswerte:

Derivative Vermögenswerte	Bruttobeträge der erfassten Vermögenswerte EUR	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge EUR	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte EUR
Devisenterminkontrakte	139	–	139
Summe	139	–	139

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Vermögenswerte EUR	Finanzinstrumente EUR	Erhaltene Barsicherheiten EUR	Nettobetrag[1] EUR
Brown Brothers Harriman	139	–	–	139
Summe	139	–	–	139

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro High Yield Fund

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten EUR	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge EUR	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten EUR
Devisenterminkontrakte	(4)	–	(4)
Summe	(4)	–	(4)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten EUR	Finanzinstrumente EUR	Verpfändete Barsicherheiten EUR	Nettobetrag[1] EUR
Brown Brothers Harriman	(4)	–	–	(4)
Summe	(4)	–	–	(4)

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

13. MANAGEMENT DES FINANZRISIKOS (Fortsetzung)

Aufrechnung (Fortsetzung)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Alle zum 31. Dezember 2023 bestehenden Derivate wurden mit Brown Brothers Harriman & Co abgeschlossen. Daher können alle Beträge aus Derivatpositionen nur bei einem Zahlungsausfall, einer Insolvenz oder einem Konkurs gegeneinander aufgerechnet werden. Zum 31. Dezember 2023 beliefen sich die Nettoverbindlichkeiten auf USD (19.232). Zum 31. Dezember 2022 hielt der Loomis Sayles Euro Credit Fund keine Derivate, die den ISDA Master-Nettingvereinbarungen unterliegen. Weitere Einzelheiten zu den zum 31. Dezember 2023 bestehenden Derivaten entnehmen Sie bitte der Vermögensaufstellung auf den Seiten 209 bis 220.

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Zum 31. Dezember 2023 hielt der Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund keine Derivate, die den ISDA Master-Nettingvereinbarungen unterliegen.

Zum 31. Dezember 2022 hielten die Fonds folgende derivative Verbindlichkeiten:

Derivative Verbindlichkeiten	Bruttobeträge der erfassten Verbindlichkeiten EUR	In der Bilanz aufgerechnete Bruttobeträge EUR	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten EUR
Credit Default Swap-Kontrakte	(3.149)	–	(3.149)
Summe	(3.149)	–	(3.149)

		In der Bilanz nicht aufgerechnete Bruttobeträge		
Kontrahent	In der Bilanz ausgewiesene Nettobeträge der Verbindlichkeiten EUR	Finanzinstrumente EUR	Verpfändete Barsicherheiten EUR	Nettobetrag[1] EUR
Citigroup Global Markets Inc	(3.149)	–	–	(3.149)
Summe	(3.149)	–	–	(3.149)

[1] „Nettobetrag“ ist der Nettobetrag, der dem Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten bei einem Ausfall geschuldet wird.

14. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Es steht der Gesellschaft frei, unter Einhaltung der von der Central Bank of Ireland von Zeit zu Zeit erlassenen Einschränkungen und der Bestimmungen des Verkaufsprospekts zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements und zur Absicherung von Währungsrisiken Finanzderivate einzusetzen, soweit dies im Rahmen der Anlageziele und -grundsätze der Fonds gestattet ist. Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 setzte die Gesellschaft Techniken für ein effizientes Portfoliomanagement in Form von Zinsfutures ein.

Die Gesellschaft schloss Devisentermingeschäfte zur Absicherung von Währungsrisiken auf Anlagen und Barmittel ab, um Benchmarkrisiken abzusichern. Weitere Devisenterminkontrakte dienten zur Absicherung der Anteilsklassen.

Die zum 31. Dezember 2023 offenen Kontrakte sind in der Vermögensaufstellung aufgelistet. Realisierte Gewinne und Verluste auf Finanzinstrumente, die für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt wurden, sind in der nachstehenden Tabelle ausgewiesen.

Zum 31. Dezember 2023

Fonds	Aufwendungen für Futures-Gebühren	Realisierter Gewinn(/Verlust)	Veränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts)
Loomis Sayles Multisector Income Fund	32.470 USD	(6.187.470) USD	3.857.863 USD
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	725 USD	(110.081) USD	5.834 USD
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	58.871 USD	333.919 USD	(348.388) USD
Loomis Sayles Euro High Yield Fund	508 EUR	(13.937) EUR	38.987 EUR
Loomis Sayles Euro Credit Fund	2.128 EUR	(294.273) EUR	385.813 EUR
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund	13.075 EUR	(741.023) EUR	780.893 EUR

Zum 31. Dezember 2022

Fonds	Aufwendungen für Futures-Gebühren	Realisierter Gewinn(/Verlust)	Veränderung des nicht realisierten Gewinns/(Verlusts)
Loomis Sayles Multisector Income Fund	10.870 USD	(9.276.198) USD	585.039 USD
Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	1.626 USD	137.569 USD	57.924 USD
Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	33.249 USD	(1.643.104) USD	(240.370) USD
Loomis Sayles Euro High Yield Fund	397 EUR	41.560 EUR	(33.337) EUR
Loomis Sayles Euro Credit Fund	1.414 EUR	1.010.550 EUR	(266.658) EUR
Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund	4.077 EUR	2.148.320 EUR	(731.898) EUR

15. SOFT-COMMISSION-VEREINBARUNGEN

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch der Portfolioverwalter hat während des Berichtszeitraums vom 1. Januar bis 31. Dezember 2023 Soft-Commission-Vereinbarungen für einen der Fonds getroffen (31. Dezember 2022: keine).

16. VERGLEICH DER NETTOINVENTARWERTE

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	USD	Anteile	USD	Anteile	USD
LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND						
- Anteilsklasse C/A (USD)	588.431	22,19	780.909	20,84	820.190	24,19
- Anteilsklasse C/D (USD)	360.734	12,21	463.361	11,77	607.577	13,89
- Anteilsklasse CT/A (USD)	28.231	10,20	4.267	9,62	458.775	11,22
- Anteilsklasse CT/DG (USD)	1.060	9,80	1.018	9,53	–	–
- Anteilsklasse CT/DM (USD)	221.171	9,46	10.130	9,07	449.260	10,73
- Anteilsklasse F/A (USD)	59.200	14,80	82.155	13,78	179.248	15,85
- Anteilsklasse F/DM (USD)	55.149	8,19	53.123	7,92	51.709	9,36
- Anteilsklasse H-I/A (EUR)	220.016	17,87	375.733	16,38	434.957	20,48
- Anteilsklasse H-I/D (EUR)	88.141	9,85	44.975	9,39	23.330	12,08
- Anteilsklasse H-I/D (GBP)	137.484	13,21	152.589	12,11	154.667	16,28
- Anteilsklasse H-N/A (CHF)	750	11,13	750	9,81	750	11,77
- Anteilsklasse H-N/A (EUR)	215.229	10,47	214.822	9,60	213.560	11,99
- Anteilsklasse H-N/D (EUR)	–	–	2.450	7,22	3.400	9,27
- Anteilsklasse H-N1/A (EUR)	467.391	10,60	273.009	9,71	149.747	12,11
- Anteilsklasse H-R/A (EUR)	1.412.458	11,07	2.794.167	10,19	5.363.933	12,83
- Anteilsklasse H-R/A (SGD)	2.593.149	8,23	2.554.156	7,67	3.392.053	8,81
- Anteilsklasse H-R/D (SGD)	450.461	6,11	549.825	5,87	584.152	6,91
- Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	97.246	5,96	99.258	5,82	119.826	7,46
- Anteilsklasse H-S/D (EUR)	72.500	7,90	76.550	7,52	76.550	9,68
- Anteilsklasse I/A (EUR)	69.702	36,16	88.171	33,57	94.286	38,50
- Anteilsklasse I/A (USD)	4.052.159	18,98	6.759.896	17,62	6.411.557	20,21
- Anteilsklasse I/D (GBP)	9.990	13,93	9.990	13,43	9.990	15,85
- Anteilsklasse I/D (USD)	3.402.352	11,34	3.081.784	10,93	3.934.924	12,91
- Anteilsklasse I/DG (USD)	1.060	9,90	1.018	9,56	–	–
- Anteilsklasse N/A (EUR)	405.992	11,44	–	–	–	–
- Anteilsklasse N/A (USD)	–	–	4.882	10,01	4.882	11,48
- Anteilsklasse N/DM (USD)	–	–	47.510	8,41	101.081	9,95
- Anteilsklasse N1/A (USD)	854.359	10,89	848.598	10,11	890.495	11,58
- Anteilsklasse N1/D (USD)	519.809	8,86	497.279	8,55	413.758	10,09
- Anteilsklasse R/A (EUR)	1.381.324	24,65	564.229	22,99	1.252.653	26,51
- Anteilsklasse R/A (SGD)	63.993	8,94	71.101	8,34	73.425	9,62
- Anteilsklasse R/A (USD)	4.492.522	16,90	5.639.617	15,76	7.069.042	18,17
- Anteilsklasse R/D (EUR)	46.010	10,16	44.529	9,79	–	–
- Anteilsklasse R/D (GBP)	102.241	18,50	110.742	17,83	112.981	21,04
- Anteilsklasse R/D (SGD)	221.962	6,39	239.943	6,16	261.747	7,27
- Anteilsklasse R/D (USD)	3.087.115	11,35	3.611.239	10,95	4.227.000	12,92
- Anteilsklasse R/DG (USD)	4.400	9,83	1.018	9,58	–	–
- Anteilsklasse R/DM (USD)	1.898.733	13,08	2.077.008	12,64	2.432.677	14,94
- Anteilsklasse RE/A (EUR)	196.665	21,92	269.448	20,52	340.197	23,74
- Anteilsklasse RE/A (USD)	5.470.337	15,52	6.044.123	14,53	6.482.821	16,80
- Anteilsklasse RE/D (USD)	97	10,68	97	9,99	97	11,54
- Anteilsklasse RE/DM (USD)	97	10,65	106	9,98	106	11,54
- Anteilsklasse S/A (USD)	3.808.468	19,06	3.886.871	17,64	3.198.512	20,18
- Anteilsklasse S/D (GBP)	678	14,04	678	13,39	3.327	15,80
- Anteilsklasse S/D (USD)	38.300	13,79	38.300	13,29	1.199.159	15,70

16. VERGLEICH DER NETTOINVENTARWERTE (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	USD	Anteile	USD	Anteile	USD
LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND						
- Anteilsklasse CT/DM (USD)	–	–	–	–	168.539	9,11
- Anteilsklasse H-I/A (EUR)	79.254	24,31	80.106	21,65	131.106	27,49
- Anteilsklasse H-N/D (EUR)	431	7,71	422	7,03	414	9,11
- Anteilsklasse H-R/A (EUR)	–	–	1.161	9,11	–	–
- Anteilsklasse I/A (EUR)	7.850	21,60	68.640	19,48	165.384	22,68
- Anteilsklasse I/A (USD)	141	25,52	141	23,02	141	26,80
- Anteilsklasse I/D (USD)	180.062	4,62	294.030	4,41	327.785	6,14
- Anteilsklasse N/DM (USD)	–	–	434	6,87	434	8,90
- Anteilsklasse R/A (EUR)	55.326	20,02	64.306	18,24	82.202	21,47
- Anteilsklasse R/A (USD)	4.280	10,78	4.280	9,83	4.280	11,56
- Anteilsklasse R/D (SGD)	–	–	–	–	550	6,21
- Anteilsklasse R/D (USD)	233.855	6,20	255.873	5,91	311.256	7,97
- Anteilsklasse R/DM (USD)	171.889	6,98	211.048	6,66	129.193	8,90
- Anteilsklasse S/A (USD)	3.100	21,52	5.500	19,39	5.500	22,54

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	USD	Anteile	USD	Anteile	USD
LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND						
- Anteilsklasse C/A (USD)	12.930	13,03	12.930	12,48	11.926	15,26
- Anteilsklasse C/D (USD)	–	–	–	–	339	9,75
- Anteilsklasse H-F/A (GBP)	300	13,59	–	–	–	–
- Anteilsklasse H-F/D (GBP)	300	13,59	–	–	–	–
- Anteilsklasse H-I/A (SGD)	–	–	152.582	6,93	134.996	7,90
- Anteilsklasse H-N/D (EUR)	393	8,72	388	8,14	359	10,94
- Anteilsklasse H-R/A (EUR)	41.208	9,54	43.286	8,84	65.155	11,05
- Anteilsklasse H-S/A (EUR)	–	–	–	–	170.573	15,85
- Anteilsklasse H-S/A (SEK)	–	–	–	–	2.448	12,25
- Anteilsklasse H-S/D (GBP)	–	–	2.475.360	9,05	2.475.502	13,43
- Anteilsklasse I/A (USD)	756.025	13,51	2.228.246	12,77	1.901.811	15,42
- Anteilsklasse I/D (USD)	56.609	10,07	69.367	9,76	521.713	13,35
- Anteilsklasse N/A (EUR)	6	11,24	6	10,79	308	13,14
- Anteilsklasse N1/A (USD)	–	–	14.888	8,92	12.754	10,75
- Anteilsklasse R/A (EUR)	161.428	18,28	193.934	17,38	189.914	21,10
- Anteilsklasse R/A (USD)	29.020	9,73	28.898	9,25	28.788	11,23
- Anteilsklasse R/D (GBP)	14.429	17,67	13.382	17,11	13.204	22,35
- Anteilsklasse R/D (USD)	117.172	10,03	163.571	9,72	171.550	13,29
- Anteilsklasse RE/A (USD)	–	–	–	–	300	10,66

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	USD	Anteile	USD	Anteile	USD
LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND						
- Anteilsklasse H-I/A (EUR)	3.000	11,71	49.122	10,30	–	–
- Anteilsklasse H-Q/A (EUR)	2.257.517	12,45	2.257.517	10,87	2.500.000	12,07
- Anteilsklasse I/A (USD)	287	11,57	287	10,29	287	10,59
- Anteilsklasse R/A (USD)	287	11,40	287	10,20	287	10,57

16. VERGLEICH DER NETTOINVENTARWERTE (Fortsetzung)

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	EUR	Anteile	EUR	Anteile	EUR
LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND						
- Anteilsklasse H-I/A (CHF)	300	10,81	300	9,35	–	–
- Anteilsklasse H-N/A (CHF)	300	10,78	300	9,34	–	–
- Anteilsklasse H-R/A (CHF)	300	10,69	300	9,30	–	–
- Anteilsklasse I/A (EUR)	52.010	10,35	10	9,28	10	10,21
- Anteilsklasse N/A (EUR)	10	10,22	10	9,16	10	10,07
- Anteilsklasse Q/A (EUR)	1.711.797	10,16	1.762.817	9,11	1.762.817	10,09
- Anteilsklasse R/A (EUR)	205	10,21	205	9,26	10	10,21
- Anteilsklasse RE/A (EUR)	1.908	9,83	300	8,92	300	10,01
- Anteilsklasse S/A (EUR)	10	10,35	10	9,28	10	10,21
- Anteilsklasse S2/A (EUR)	1.493.494	9,99	1.266.362	8,98	1.452.152	9,97

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	EUR	Anteile	EUR	Anteile	EUR
LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND						
- Anteilsklasse H-I/A (USD)	70.000	9,72	–	–	–	–
- Anteilsklasse I/A (EUR)	57.079	9,35	33.488	8,59	50.688	9,89
- Anteilsklasse I/D (EUR)	129.500	10,53	–	–	–	–
- Anteilsklasse N/A (EUR)	10	9,42	10	8,62	10	9,97
- Anteilsklasse Q/A (EUR)	573.523	9,43	4.058.366	8,63	7.000.000	9,91
- Anteilsklasse R/A (EUR)	3.649	9,28	3.418	8,57	10	9,91
- Anteilsklasse RE/A (EUR)	300	9,22	300	8,52	300	9,88
- Anteilsklasse S/A (EUR)	2.915.761	9,34	505.145	8,57	10	9,91
- Anteilsklasse S/D (EUR)	330.948	10,46	–	–	–	–
- Anteilsklasse S1/A (EUR)	2.126.620	10,65	–	–	–	–
- Anteilsklasse S2/A (EUR)	6.750.768	9,40	7.200.534	8,61	5.127.128	9,90

	Zum 31. Dezember 2023		Zum 31. Dezember 2022		Zum 31. Dezember 2021	
	Anteile	EUR	Anteile	EUR	Anteile	EUR
LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND						
- Anteilsklasse G/A (EUR)	11.600.194	10,28	–	–	–	–
- Anteilsklasse I/A (EUR)	1.656.134	9,44	300	8,68	300	10,03
- Anteilsklasse N/A (EUR)	6.250	9,40	14.900	8,67	14.900	10,02
- Anteilsklasse Q/A (EUR)	15.292.711	9,52	10.754.005	8,73	6.636.246	10,04
- Anteilsklasse R/A (EUR)	809.682	9,35	1.425	8,64	300	10,00
- Anteilsklasse RE/A (EUR)	299	9,37	299	8,64	299	10,00
- Anteilsklasse S/A (EUR)	2.111.611	9,46	625.458	8,70	300	10,03
- Anteilsklasse S2/A (EUR)	41.035.266	9,48	23.170.387	8,71	11.378.962	10,04
- Anteilsklasse S3/A (EUR)	16.488.145	9,75	10.751.259	8,95	–	–
- Anteilsklasse S3/D (EUR)	300	9,94	300	9,13	–	–

17. WESENTLICHE EREIGNISSE IM GESCHÄFTSJAHR

Der aktuelle Prospekt wurde am 21. Januar 2022 von der irischen Zentralbank genehmigt und ersetzt den Prospekt vom 24. September 2020.

Im Geschäftsjahr wurden keine weiteren für die Gesellschaft wesentlichen Ereignisse verzeichnet.

18. FINANZAUFWAND

In den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2023 und 31. Dezember 2022 hat die Gesellschaft die folgenden Dividenden erklärt und gezahlt:

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse C/D (USD)	3. Juli 2023	0,071000000
Anteilsklasse CT/DG (USD)	3. Juli 2023	0,028000000
Anteilsklasse CT/DG (USD)	1. Dezember 2023	0,036000000
Anteilsklasse CT/DM (USD)	3. Juli 2023	0,013000000
Anteilsklasse CT/DM (USD)	1. Dezember 2023	0,032000000
Anteilsklasse F/DM (USD)	3. Juli 2023	0,022000000
Anteilsklasse F/DM (USD)	1. Dezember 2023	0,029000000
Anteilsklasse H-I/D (EUR)	3. Juli 2023	0,087251998
Anteilsklasse H-I/D (GBP)	3. Juli 2023	0,112936546
Anteilsklasse H-R/D (SGD)	3. Juli 2023	0,045196903
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	3. Juli 2023	0,012030299
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	1. Dezember 2023	0,017917198
Anteilsklasse H-S/D (EUR)	3. Juli 2023	0,075254849
Anteilsklasse I/D (GBP)	3. Juli 2023	0,119281295
Anteilsklasse I/D (USD)	3. Juli 2023	0,099000000
Anteilsklasse I/DG (USD)	3. Juli 2023	0,028000000
Anteilsklasse I/DG (USD)	1. Dezember 2023	0,036000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	3. Juli 2023	0,025000000
Anteilsklasse N1/D (USD)	3. Juli 2023	0,080000000
Anteilsklasse R/D (EUR)	3. Juli 2023	0,076345499
Anteilsklasse R/D (GBP)	3. Juli 2023	0,138315545
Anteilsklasse R/D (SGD)	3. Juli 2023	0,048160634
Anteilsklasse R/D (USD)	3. Juli 2023	0,085000000
Anteilsklasse R/DG (USD)	3. Juli 2023	0,032000000
Anteilsklasse R/DG (USD)	1. Dezember 2023	0,040000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	3. Juli 2023	0,032000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Dezember 2023	0,044000000
Anteilsklasse S/D (GBP)	3. Juli 2023	0,096440196
Anteilsklasse S/D (USD)	3. Juli 2023	0,131000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2023	(3.357.208)	(842.379)	(4.199.587)

18. FINANZAUFWAND (Fortsetzung)

Loomis Sayles Multisector Income Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse C/D (USD)	1. Juli 2022	0,056000000
Anteilsklasse CT/DG (USD)	1. Juli 2022	0,027000000
Anteilsklasse CT/DG (USD)	1. Dezember 2022	0,026000000
Anteilsklasse CT/DM (USD)	1. Juli 2022	0,013000000
Anteilsklasse CT/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,013000000
Anteilsklasse F/DM (USD)	1. Juli 2022	0,020000000
Anteilsklasse F/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,019000000
Anteilsklasse H-I/D (EUR)	1. Juli 2022	0,076897098
Anteilsklasse H-I/D (GBP)	1. Juli 2022	0,102046746
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	1. Juli 2022	0,055074949
Anteilsklasse H-R/D (SGD)	1. Juli 2022	0,037890974
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	1. Juli 2022	0,011511549
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)	1. Dezember 2022	0,012258899
Anteilsklasse H-S/D (EUR)	1. Juli 2022	0,066505599
Anteilsklasse I/D (GBP)	1. Juli 2022	0,105648395
Anteilsklasse I/D (USD)	1. Juli 2022	0,088000000
Anteilsklasse I/DG (USD)	1. Juli 2022	0,027000000
Anteilsklasse I/DG (USD)	1. Dezember 2022	0,026000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	1. Juli 2022	0,024000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,023000000
Anteilsklasse N1/D (USD)	1. Juli 2022	0,071000000
Anteilsklasse R/D (EUR)	1. Juli 2022	0,064427299
Anteilsklasse R/D (GBP)	1. Juli 2022	0,117653895
Anteilsklasse R/D (SGD)	1. Juli 2022	0,040750670
Anteilsklasse R/D (USD)	1. Juli 2022	0,073000000
Anteilsklasse R/DG (USD)	1. Juli 2022	0,028000000
Anteilsklasse R/DG (USD)	1. Dezember 2022	0,026000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Juli 2022	0,031000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,028000000
Anteilsklasse S/D (GBP)	1. Juli 2022	0,103247296
Anteilsklasse S/D (USD)	1. Juli 2022	0,117000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2022	(4.095.783)	–	(4.095.783)

Loomis Sayles High Income Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	3. Juli 2023	0,041444699
Anteilsklasse I/D (USD)	3. Juli 2023	0,062000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	3. Juli 2023	0,013000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	1. Dezember 2023	0,013000000
Anteilsklasse R/D (USD)	3. Juli 2023	0,068000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	3. Juli 2023	0,026000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Dezember 2023	0,025000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2023	(147.679)	(40.884)	(188.563)

18. FINANZAUFWAND (Fortsetzung)

Loomis Sayles High Income Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	1. Juli 2022	0,038448549
Anteilsklasse I/D (USD)	1. Juli 2022	0,058000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	1. Juli 2022	0,013000000
Anteilsklasse N/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,013000000
Anteilsklasse R/D (SGD)	1. Juli 2022	0,012153709
Anteilsklasse R/D (USD)	1. Juli 2022	0,061000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Juli 2022	0,025000000
Anteilsklasse R/DM (USD)	1. Dezember 2022	0,025000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2022	(211.334)	(698.627)	(909.961)

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	3. Juli 2023	0,027266249
Anteilsklasse I/D (USD)	3. Juli 2023	0,062000000
Anteilsklasse R/D (GBP)	3. Juli 2023	0,081212797
Anteilsklasse R/D (USD)	3. Juli 2023	0,047000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2023	(33.858)	(150.226)	(184.084)

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse H-N/D (EUR)	1. Juli 2022	0,011430650
Anteilsklasse H-S/D (GBP)	1. Juli 2022	0,048021998
Anteilsklasse I/D (USD)	1. Juli 2022	0,042000000
Anteilsklasse R/D (GBP)	1. Juli 2022	0,044420348
Anteilsklasse R/D (USD)	1. Juli 2022	0,026000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2022	(550.988)	(4.624.724)	(5.175.712)

Loomis Sayles Euro Credit Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse I/D (EUR)	3. Juli 2023	0,027000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2023	(17.269)	–	(17.269)

18. FINANZAUFWAND (Fortsetzung)

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

Anteilsklasse	Ex-Datum	Ausschüttung pro Anteil in USD
Anteilsklasse S3/D (EUR)	3. Juli 2023	0,002000000

datum	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD	Summe Betrag USD
31. Dezember 2023	(2)	–	(2)

19. EREIGNISSE NACH ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES

Einzelheiten zu den von der Gesellschaft nach Ende des Geschäftsjahres erklärten und ausgeschütteten Dividenden finden sich in der nachstehenden Tabelle:

Loomis Sayles Multisector Income Fund

datum	Anzahl der rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD
2. Januar 2024	10.816.596	–	1.160.379
1. Februar 2024	2.218.781	89.073	–

Loomis Sayles High Income Fund

datum	Anzahl der rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD
2. Januar 2024	586.237	–	33.961
1. Februar 2024	152.978	4.130	–

Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund

datum	Anzahl der rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile	Ertragsausschüttung Betrag USD	Kapitalausschüttung Betrag USD
2. Januar 2024	188.903	–	15.138

Loomis Sayles Euro Credit Fund

datum	Anzahl der rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile	Ertragsausschüttung Betrag EUR	Kapitalausschüttung Betrag EUR
2. Januar 2024	460.448	–	37.627

Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund

datum	Anzahl der rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteile	Ertragsausschüttung Betrag EUR	Kapitalausschüttung Betrag EUR
2. Januar 2024	300	–	2

19. EREIGNISSE NACH ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES (Fortsetzung)

Wechsel der Verwaltungsgesellschaft

Die Gesellschaft hat Natixis Investment Managers S.A. („NIM SA“) am 21. Januar 2022 zu ihrer Verwaltungsgesellschaft ernannt. NIM SA ist eine luxemburgische Gesellschaft, die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner aktuellen Fassung zugelassen ist und von ihr beaufsichtigt wird. Ihre Hauptgeschäftstätigkeit ist die Verwaltung kollektiver Anlageportfolios.

Die gesamte Natixis-Gruppe hat im Sinne einer Straffung der Organisation, einer Steigerung der operativen Effizienz und einer Vereinfachung der bestehenden Strukturen innerhalb der Organisation ihr Geschäftsmodell überprüft. Im Rahmen dieser Überprüfung wurde beschlossen, NIM SA mit einer anderen Verwaltungsgesellschaft der Natixis-Gruppe, Natixis Investment Managers International („NIMI“), zu verschmelzen.

NIMI ist im Handelsregister von Paris unter der Nummer 329 450 738 eingetragen und hat ihren Sitz in 43, avenue Pierre Mendès-France, 75013 Paris. NIMI ist von der Autorité des Marchés Financiers („AMF“), der Finanzaufsichtsbehörde in Frankreich, als OGAW- und AIFM-Verwaltungsgesellschaft zugelassen. NIMI wurde von der Central Bank of Ireland als OGAW-Verwaltungsgesellschaft für die grenzüberschreitende Erbringung von Dienstleistungen und Tätigkeiten in Irland zugelassen.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat beschlossen, dass nach dem Zusammenschluss der beiden Verwaltungsgesellschaften der Natixis-Gruppe NIMI zur Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft ernannt wird und die bisherige Verwaltungsgesellschaft NIM S.A. ersetzt. Diese Änderung trat am 1. April 2024 in Kraft.

Bestellung von Loomis Sayles (Netherlands) B.V. als Anlageverwalter mit Wirkung zum 1. April 2024

NIMI beabsichtigt, eine neue Tochtergesellschaft des Anlageverwalters, Loomis Sayles L.P., zu ernennen, um individuelle Portfolioverwaltungsdienstleistungen für den Loomis Sayles Euro Credit Fund, den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund und den Loomis Sayles Euro High Yield Fund zu erbringen.

Es war beabsichtigt, eine neue Tochtergesellschaft des Portfolioverwalters, Loomis Sayles L.P., mit neuem Sitz in den Niederlanden zu ernennen, um individuelle Portfolioverwaltungsdienstleistungen für den Loomis Sayles Euro Credit Fund, den Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund und den Loomis Sayles Euro High Yield Fund zu erbringen, sobald diese neue Tochtergesellschaft von der niederländischen Finanzmarktaufsicht (die „AFM“) genehmigt/zugelassen wurde.
NL Loomis wurde am 31. August 2023 von der AFM als AIFM für die Verwaltung alternativer Investmentfonds zugelassen. NL Loomis ist von der AFM auch für die Erbringung von individuellen Portfolioverwaltungsdienstleistungen sowie für die Erbringung von nicht zum Kerngeschäft gehörenden Dienstleistungen (einschließlich Anlageberatung, Vertrieb und Marketing) zugelassen.

Liquidation des Loomis Sayles Alternative Risk Premia

Nach Rücksprache mit der Verwaltungsgesellschaft hat der Verwaltungsrat beschlossen, dass der Fonds seit seiner Auflegung im Oktober 2020 nicht genügend Vermögenswerte angesammelt hat, um wirtschaftlich tragfähig zu sein, und dass die Aussichten auf künftiges Wachstum begrenzt sind. Daher hat der Verwaltungsrat beschlossen, dass es im besten Interesse der Anteilinhaber wäre, den Fonds gemäß den Bestimmungen des Prospekts zu liquidieren.

Den Anteilinhabern wurde mitgeteilt, dass ihre Anteile am 19. März 2024 zwangsweise zurückgenommen werden.

Mit Wirkung zum 1. April 2024 ist ein neuer Prospekt in Kraft getreten, in dem unter anderem ein Wechsel der Verwaltungsgesellschaft von Natixis Investment Managers S.A. zu Natixis Investment Managers International bekannt gegeben und über die Auflösung des Alternative Risk Premia Fund informiert wurde.

Seit dem Geschäftsjahresende wurden keine weiteren für die Gesellschaft wesentlichen Ereignisse verzeichnet.

20. VERABSCHIEDUNG DES ABSCHLUSSES

Der Verwaltungsrat hat den Abschluss am 30. April 2024 verabschiedet.

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 93,60 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 94,26 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 88,79 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 89,21 %)				
Werbung - 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp, 7,375 %, 15.02.31 144A (i)	USD	150.000	157.521	0,03
			157.521	0,03
Luft- und Raumfahrt/Verteidigung - 0,69 % (31. Dezember 2022: 0,30 %)				
Embraer Netherlands Finance BV, 7,000 %, 28.07.30 144A (i) (ii)	USD	1.110.000	1.164.386	0,21
RTX Corp, 2,375 %, 15.03.32	USD	190.000	158.336	0,03
RTX Corp, 5,150 %, 27.02.33	USD	1.480.000	1.508.334	0,28
TransDigm Inc, 6,250 %, 15.03.26 144A (i)	USD	620.000	618.929	0,11
TransDigm Inc, 6,750 %, 15.08.28 144A (i)	USD	320.000	327.386	0,06
			3.777.371	0,69
Fluggesellschaften - 0,94 % (31. Dezember 2022: 1,85 %)				
American Airlines, 3,700 %, 15.10.25	USD	699.168	657.734	0,12
American Airlines, 3,750 %, 15.10.25	USD	2.057.281	1.919.609	0,35
American Airlines, 4,950 %, 15.02.25	USD	888.250	862.843	0,16
United Airlines, 3,650 %, 07.10.25	USD	622.222	605.697	0,11
United Airlines, 4,000 %, 11.04.26	USD	1.166.422	1.114.007	0,20
			5.159.890	0,94
Autos - 2,69 % (31. Dezember 2022: 2,59 %)				
General Motors Co, 6,250 %, 02.10.43	USD	895.000	913.010	0,17
General Motors Financial Co Inc, 5,700 % (iii) (iv)	USD	145.000	133.906	0,02
General Motors Financial Co Inc, 5,750 % (iii) (iv)	USD	90.000	79.830	0,01
General Motors Financial Co Inc, 6,000 %, 09.01.28	USD	1.755.000	1.814.537	0,33
General Motors Financial Co Inc, 6,400 %, 09.01.33	USD	2.245.000	2.388.910	0,44
Toyota Motor Credit Corp, 0,500 %, 18.06.24	USD	8.845.000	8.640.022	1,57
ZF North America Capital Inc 6,875 % 14.04.28 144A (i)	USD	380.000	395.055	0,07
ZF North America Capital Inc 7,125 % 14.04.30 144A (i)	USD	400.000	424.935	0,08
			14.790.205	2,69
Banken - 8,94 % (31. Dezember 2022: 9,00 %)				
AIB Group PLC, 6,608 %, 13.09.29 144A (i) (ii) (iii)	USD	260.000	273.898	0,05
Bank of America Corp, 4,376 %, 27.04.28 (iii)	USD	1.560.000	1.524.586	0,28
Bank of America Corp, 5,288 %, 25.04.34 (iii)	USD	570.000	571.312	0,10
Bank of America Corp, 5,872 %, 15.09.34 (iii)	USD	1.415.000	1.481.180	0,27
Bank of America Corp, 6,110 %, 29.01.37	USD	810.000	863.613	0,16
Barclays PLC, 4,375 % (ii) (iii) (iv)	USD	1.915.000	1.488.732	0,27
Barclays PLC, 6,224 %, 09.05.34 (ii) (iii)	USD	2.695.000	2.795.189	0,51
Barclays PLC, 7,119 %, 27.06.34 (ii) (iii)	USD	4.965.000	5.291.324	0,96
BNP Paribas SA, 5,198 %, 10.01.30 144A (i) (ii) (iii)	USD	1.810.000	1.811.627	0,33
CaixaBank SA, 6,840 %, 13.09.34 144A (i) (ii) (iii)	USD	740.000	781.002	0,14
Credit Agricole SA, 3,250 %, 14.01.30 144A (i) (ii)	USD	805.000	710.588	0,13
Credit Agricole SA, 4,000 %, 10.01.33 EMTN (ii) (iii)	USD	940.000	869.996	0,16

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Banken- 8,94 % (31. Dezember 2022: 9,00 %) (Fortsetzung)				
Deutsche Bank AG, 7,079 %, 10.02.34 (ii) (iii)	USD	2.795.000	2.874.226	0,52
Goldman Sachs Group Inc, 6,125 %, 2/15/33	USD	45.000	49.429	0,01
ING Groep NV, 6,114 %, 11.09.34 (ii) (iii)	USD	380.000	398.531	0,07
Intesa Sanpaolo SpA, 6,625 %, 20.06.33 144A (i) (ii)	USD	580.000	594.347	0,11
Intesa Sanpaolo SpA, 7,200 %, 28.11.33 144A (i) (ii)	USD	1.170.000	1.248.660	0,23
JPMorgan Chase & Co, 5,350 %, 01.06.34 (iii)	USD	6.165.000	6.252.755	1,14
Morgan Stanley, 4,350 %, 08.09.26	USD	1.490.000	1.462.233	0,27
Morgan Stanley, 4,431 %, 23.01.30 (iii)	USD	915.000	891.189	0,16
Morgan Stanley, 5,424 %, 21.07.34 (iii)	USD	835.000	847.423	0,15
Morgan Stanley, 5,948 %, 19.01.38 (iii)	USD	1.285.000	1.299.513	0,24
NatWest Group PLC, 5,516 %, 30.09.28 (ii) (iii)	USD	285.000	286.512	0,05
NatWest Group PLC, 5,808 %, 13.09.29 (ii) (iii)	USD	1.970.000	2.019.628	0,37
Standard Chartered PLC, 6,296 %, 06.07.34 144A (i) (ii) (iii)	USD	5.395.000	5.661.760	1,03
Synchrony Bank, 5,400 %, 22.08.25	USD	470.000	462.969	0,08
Synchrony Bank, 5,625 %, 23.08.27	USD	955.000	939.391	0,17
UBS Group AG, 6,442 %, 11.08.28 144A (i) (ii) (iii)	USD	1.360.000	1.410.890	0,26
UBS Group AG, 6,537 %, 12.08.33 144A (i) (ii) (iii)	USD	1.000.000	1.067.157	0,20
UBS Group AG, 9,016 %, 15.11.33 144A (i) (ii) (iii)	USD	850.000	1.044.850	0,19
UniCredit SpA, 5,459 %, 30.06.35 144A (i) (ii) (iii)	USD	1.925.000	1.810.420	0,33
			49.084.930	8,94
Getränke - 0,24 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Bacardi Ltd/Bacardi-Martini BV, 5,400 %, 15.06.33 144A (i) (ii)	USD	1.305.000	1.311.525	0,24
			1.311.525	0,24
Baumaterialien - 1,78 % (31. Dezember 2022: 1,56 %)				
Carrier Global Corp, 5,900 %, 15.03.34 144A (i)	USD	245.000	264.991	0,05
Cemex SAB de CV, 3,875 %, 11.07.31 144A (i) (ii)	USD	3.110.000	2.781.478	0,51
Cemex SAB de CV, 9,125 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)	USD	4.950.000	5.271.750	0,96
JELD-WEN Inc, 4,875 %, 15.12.27 144A (i)	USD	890.000	841.050	0,15
Masco Corp, 6,500 %, 15.08.32	USD	112.000	122.113	0,02
Masco Corp, 7,750 %, 01.08.29	USD	464.000	515.885	0,09
			9.797.267	1,78
Chemiewerte - 0,80 % (31. Dezember 2022: 0,59 %)				
Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, 31.01.30 144A (i) (ii)	USD	220.000	170.756	0,03
Braskem Netherlands Finance BV, 5,875 %, 31.01.50 144A (i) (ii)	USD	1.260.000	873.084	0,16
Braskem Netherlands Finance BV, 8,500 %, 12.01.31 144A (i) (ii)	USD	520.000	483.600	0,09
Celanese US Holdings LLC, 6,330 %, 15.7.29	USD	510.000	534.619	0,10
Celanese US Holdings LLC, 6,379 %, 15.7.32	USD	330.000	348.838	0,06

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Chemiewerte – 0,80 % (31. Dezember 2022: 0,59 %) (Fortsetzung)				
Celanese US Holdings LLC, 6,550 %, 15.11.30	USD	370.000	391.137	0,07
Celanese US Holdings LLC, 6,700 %, 15.11.33	USD	1.470.000	1.594.359	0,29
			4.396.393	0,80
Commercial MBS - 0,35 % (31. Dezember 2022: 0,51 %)				
GS Mortgage Securities Corp Trust, 3,550 %, 05.03.33 144A (i) (iii)	USD	405.000	310.983	0,06
GS Mortgage Securities Trust, 4,885 %, 10.01.47 (iii)	USD	355.000	330.764	0,06
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 3,784%, 15.12.47 144A (i) (iii)	USD	696.354	616.969	0,11
MSBAM Commercial Mortgage Securities Trust, 3,277 %, 15.10.30 144A (i)	USD	146.487	126.042	0,02
WFRBS Commercial Mortgage Trust, 4,378 %, 15.05.47	USD	665.000	515.242	0,10
			1.900.000	0,35
Gewerbliche Dienste - 1,58 % (31. Dezember 2022: 0,69 %)				
Ashtead Capital Inc, 5,500 %, 11.08.32 144A (i)	USD	240.000	237.078	0,04
Ashtead Capital Inc, 5,550 %, 30.05.33 144A (i)	USD	385.000	380.939	0,07
Ashtead Capital Inc, 5,950 %, 15.10.33 144A (i)	USD	2.210.000	2.251.547	0,41
Block Inc, 3,500 %, 01.06.31	USD	960.000	852.433	0,15
Equifax Inc, 7,000 %, 01.07.37	USD	370.000	412.969	0,07
Gartner Inc, 3,625 %, 15.06.29 144A (i)	USD	595.000	537.037	0,10
Gartner Inc, 3,750 %, 01.10.30 144A (i)	USD	110.000	97.237	0,02
Global Payments Inc, 5,300 %, 15.08.29	USD	360.000	362.352	0,07
Global Payments Inc, 5,400 %, 15.08.32	USD	1.845.000	1.862.984	0,34
GTCR W-2 Merger Sub LLC, 7,500%, 15.01.31 144A (i)	USD	1.075.000	1.135.976	0,21
TriNet Group Inc, 3,500 %, 01.03.29 144A (i)	USD	620.000	554.649	0,10
			8.685.201	1,58
Computer - 1,03 % (31. Dezember 2022: 1,04 %)				
Dell International LLC/EMC Corp, 8.100 %, 15.07.36	USD	1.460.000	1.795.653	0,33
Dell International LLC/EMC Corp, 8.350 %, 15.07.46	USD	207.000	271.846	0,05
Leidos Inc, 4,375 %, 15.05.30	USD	140.000	134.034	0,03
Leidos Inc, 5,750 %, 15.03.33	USD	1.445.000	1.506.814	0,27
Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 06.01.29 (ii)	USD	85.000	78.765	0,01
Seagate HDD Cayman, 9,625 %, 12.01.32 (ii)	USD	61.200	69.982	0,01
Western Digital Corp, 2,850 %, 01.02.29	USD	745.000	641.353	0,12
Western Digital Corp, 4,750 %, 15.02.26	USD	1.160.000	1.137.981	0,21
			5.636.428	1,03
Elektrowerte - 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,32 %)				
Enel Finance International NV, 6,000 %, 07.10.39 (ii)	USD	1.300.000	1.321.086	0,24
Pacific Gas & Electric Co, 5,450 %, 15.06.27	USD	405.000	408.263	0,08
Southern Co, 5,700 %, 15.03.34	USD	640.000	672.975	0,12
			2.402.324	0,44

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Elektronik - 0,94 % (31. Dezember 2022: 0,82 %)				
Avnet Inc, 5,500 %, 01.06.32	USD	1.600.000	1.582.984	0,29
Flex Ltd, 6,000 %, 15.01.28 (ii)	USD	1.025.000	1.058.354	0,19
Sensata Technologies BV, 4,000 %, 15.04.29 144A (i) (ii)	USD	855.000	794.564	0,14
Sensata Technologies BV, 5,875 %, 01.09.30 144A (i) (ii)	USD	200.000	198.703	0,04
Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15.02.31 144A (i)	USD	95.000	83.669	0,02
Trimble Inc, 6,100 %, 15.03.33	USD	1.330.000	1.423.368	0,26
			5.141.642	0,94
Bau und Maschinenbau - 0,26 % (31. Dezember 2022: 0,28 %)				
IHS Holding Ltd, 5,625 %, 29.11.26 144A (i) (ii)	USD	950.000	824.353	0,15
TopBuild Corp, 4,125 %, 15.02.32 144A (i)	USD	655.000	582.676	0,11
			1.407.029	0,26
Unterhaltung - 0,88 % (31. Dezember 2022: 0,60 %)				
Genm Capital Labuan Ltd, 3,882 %, 19.04.31 144A (i) (ii)	USD	2.160.000	1.842.729	0,34
Light & Wonder International Inc, 7,000 %, 15.05.28 144A (i)	USD	555.000	560.648	0,10
Light & Wonder International Inc, 7,250 %, 15.11.29 144A (i)	USD	45.000	46.076	0,01
Light & Wonder International Inc, 7,500 %, 01.09.31 144A (i)	USD	275.000	286.840	0,05
Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, 15.03.29	USD	480.000	455.420	0,08
Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, 15.03.32	USD	1.790.000	1.638.215	0,30
			4.829.928	0,88
Umweltkontrolle - 0,27 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Veralto Corp, 5,450 %, 18.09.33 144A (i)	USD	1.440.000	1.491.507	0,27
			1.491.507	0,27
Finanzen - 6,48 % (31. Dezember 2022: 4,27 %)				
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, 30.01.32 (ii)	USD	1.050.000	913.846	0,17
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, 29.10.33 (ii)	USD	150.000	128.801	0,02
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 5,750 % 06.06.2028 (ii)	USD	202.000	206.735	0,04
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust, 6,150 %, 30.09.30 (ii)	USD	3.385.000	3.564.706	0,65
AGFC Capital Trust I, 7,405 %, 15.01.67 (iii)	USD	400.000	206.480	0,04
Air Lease Corp, 4,625 %, 01.10.28	USD	847.000	827.513	0,15
Air Lease Corp, 4,650 % (iii) (iv)	USD	1.890.000	1.696.834	0,31
Aircastle Ltd, 6,500 %, 18.07.28 144A (i) (ii)	USD	1.245.000	1.269.547	0,23
Ally Financial Inc, 4,700 % (iii) (iv)	USD	2.200.000	1.650.136	0,30
Ally Financial Inc, 4,700 % (iii) (iv)	USD	1.865.000	1.265.323	0,23
Ally Financial Inc, 6,992 %, 13.06.29 (iii)	USD	540.000	557.689	0,10
Antares Holdings LP, 7,950 % 11.08.28 144A (i)	USD	2.295.000	2.374.187	0,43
Aviation Capital Group LLC, 6,250 %, 15.04.28 144A (i)	USD	1.085.000	1.104.944	0,20
Aviation Capital Group LLC, 6,375 %, 15.07.30 144A (i)	USD	1.225.000	1.261.171	0,23
Aviation Capital Group LLC, 6,750 %, 25.10.28 144A (i)	USD	945.000	986.514	0,18

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Finanzen – 6,48 % (31. Dezember 2022: 4,27 %) (Fortsetzung)				
Jefferies Group Inc, 5,875 %, 21.07.28	USD	370.000	379.399	0,07
Jefferies Group Inc, 6,250 %, 15.01.36	USD	1.970.000	2.070.615	0,38
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,000 % 01.02.26 144A (i)	USD	540.000	528.097	0,10
Navient Corp, 5,000 %, 15.03.27	USD	725.000	699.955	0,13
Navient Corp, 5,625 %, 01.08.33	USD	730.000	598.856	0,11
Navient Corp, 6,750 %, 15.06.26	USD	320.000	325.324	0,06
OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15.01.27	USD	95.000	87.917	0,02
OneMain Finance Corp, 3,875 %, 15.09.28	USD	105.000	92.899	0,02
OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15.09.30	USD	280.000	239.612	0,04
OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15.11.29	USD	380.000	355.831	0,06
OneMain Finance Corp, 6,875 %, 15.03.25	USD	940.000	951.543	0,17
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 2,875 %, 15.10.26 144A (i)	USD	4.460.000	4.114.350	0,75
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,625 %, 01.03.29 144A (i)	USD	1.585.000	1.434.562	0,26
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01.03.31 144A (i)	USD	4.030.000	3.544.369	0,64
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15.10.33 144A (i)	USD	2.535.000	2.153.555	0,39
			35.591.310	6,48
Erdgas – 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Southern Co Gas Capital Corp, 5,750 %, 15.09.33	USD	305.000	320.249	0,06
			320.249	0,06
Gesundheit - 1,86 % (31. Dezember 2022: 1,16 %)				
Alcon Finance Corp, 5,375 %, 06.12.32 144A (i)	USD	575.000	593.074	0,11
Bausch & Lomb Escrow Corp, 8,375 %, 01.10.28 144A (i)	USD	15.000	15.824	0,00
Centene Corp, 2,500 %, 01.03.31	USD	2.345.000	1.953.763	0,36
Centene Corp, 2,625 %, 01.08.31	USD	1.055.000	875.357	0,16
Centene Corp, 3,000 %, 15.10.30	USD	815.000	705.826	0,13
Centene Corp, 3,375 %, 15.02.30	USD	210.000	188.418	0,03
Centene Corp, 4,625 %, 15.12.29	USD	460.000	441.015	0,08
HCA Inc, 5,500 %, 01.06.33	USD	2.935.000	2.981.087	0,54
Hologic Inc, 3,250 %, 15.02.29 144A (i)	USD	465.000	421.578	0,08
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15.05.32 144A (i)	USD	440.000	384.456	0,07
Molina Healthcare Inc, 4,375 %, 15.06.28 144A (i)	USD	860.000	813.370	0,15
Star Parent Inc, 9,000 %, 01.10.30 144A (i)	USD	790.000	832.544	0,15
			10.206.312	1,86
Wohnungsbau - 1,13 % (31. Dezember 2022: 1,61 %)				
Beazer Homes USA Inc, 7,250 %, 15.10.29	USD	1.555.000	1.568.362	0,29
MDC Holdings Inc, 6,000 %, 15.01.43	USD	3.335.000	3.100.221	0,56
PulteGroup Inc, 6,375 %, 15.05.33	USD	1.385.000	1.513.214	0,28
			6.181.797	1,13

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Versicherung - 2,20 % (31. Dezember 2022: 1,78 %)				
Athene Global Funding, 3,205 %, 08.03.27 144A (i)	USD	1.575.000	1.445.285	0,26
Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, 22.06.47	USD	577.000	458.601	0,09
Brighthouse Financial Inc, 5,625 %, 15.05.30	USD	2.880.000	2.916.610	0,53
HUB International Ltd, 7,250 %, 15.06.30 144A (i)	USD	990.000	1.045.668	0,19
MBIA Insurance Corp, 16,853 %, 15.01.33	USD	150.000	5.250	0,00
Penn Mutual Life Insurance Co, 7,625 %, 15.06.40 *	USD	4.225.000	4.787.916	0,87
Stewart Information Services Corp, 3,600 %, 15.11.31	USD	1.845.000	1.437.116	0,26
			12.096.446	2,20
Internet - 3,37 % (31. Dezember 2022: 3,06 %)				
Expedia Group Inc, 3,250 %, 15.02.30	USD	1.125.000	1.031.295	0,19
Netflix Inc, 4,875 %, 15.06.30 144A (i)	USD	2.395.000	2.425.060	0,44
Netflix Inc, 5,375 %, 15.11.29 144A (i)	USD	295.000	304.770	0,06
Netflix Inc, 5,875 %, 15.11.28	USD	1.460.000	1.537.063	0,28
Netflix Inc, 6,375 %, 15.05.29	USD	1.965.000	2.136.460	0,39
Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15.08.29 144A (i)	USD	5.945.000	5.671.331	1,03
Uber Technologies Inc, 7,500 %, 15.09.27 144A (i)	USD	5.025.000	5.204.041	0,95
Uber Technologies Inc, 8,000 %, 01.11.26 144A (i)	USD	175.000	178.246	0,03
			18.488.266	3,37
Investmentgesellschaften - 2,55 % (31. Dezember 2022: 2,98 %)				
Ares Capital Corp, 3,200 %, 15.11.31	USD	3.765.000	3.148.731	0,57
Barings BDC Inc, 3,300 %, 23.11.26	USD	995.000	907.244	0,17
Blue Owl Capital Corp, 4,250 %, 15.01.26	USD	3.140.000	3.033.893	0,55
Blue Owl Technology Finance Corp, 4,750 %, 15.12.25 144A (i)	USD	4.075.000	3.853.507	0,70
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01.02.29	USD	3.660.000	3.056.320	0,56
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15.05.27	USD	5.000	4.491	0,00
			14.004.186	2,55
Eisen/Stahl - 0,38 % (31. Dezember 2022: 0,10 %)				
ArcelorMittal SA, 6,750 %, 01.03.41 (ii)	USD	590.000	623.821	0,11
ArcelorMittal SA, 6,800 %, 29.11.32 (ii)	USD	1.355.000	1.465.308	0,27
			2.089.129	0,38
Freizeit - 1,55 % (31. Dezember 2022: 0,82 %)				
Carnival Corp, 4,000 %, 01.08.28 144A (i) (ii)	USD	235.000	218.488	0,04
Carnival Corp, 5,750 %, 01.03.27 144A (i) (ii)	USD	1.480.000	1.443.642	0,26
Carnival Corp, 6,000 %, 01.05.29 144A (i) (ii)	USD	350.000	336.772	0,06
Carnival Corp, 7,000 %, 15.08.29 144A (i) (ii)	USD	195.000	203.603	0,04
Carnival Corp, 9,875%, 01.08.27 144A (i) (ii)	USD	540.000	566.920	0,10
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15.03.26 144A (i) (ii)	USD	1.115.000	1.089.531	0,20
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15.02.27 144A (i) (ii)	USD	835.000	825.009	0,15

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Freizeit – 1,55 % (31. Dezember 2022: 0,82 %) (Fortsetzung)				
NCL Corp Ltd, 8,125 %, 15.01.29 144A (i) (ii)	USD	930.000	971.461	0,18
NCL Finance Ltd, 6,125 %, 15.03.28 144A (i) (ii)	USD	410.000	392.465	0,07
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01.07.26 144A (i) (ii)	USD	65.000	62.782	0,01
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01.04.28 144A (i) (ii)	USD	2.440.000	2.408.912	0,44
			8.519.585	1,55
Hotels - 0,88 % (31. Dezember 2022: 0,77 %)				
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01.07.31 144A (i)	USD	270.000	239.005	0,04
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5,000 %, 01.06.29 144A (i)	USD	900.000	830.291	0,15
Marriott International Inc, 2,850 %, 15.04.31	USD	1.255.000	1.086.169	0,20
Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15.06.29 144A (i)	USD	695.000	612.441	0,11
Travel + Leisure Co, 4,500 %, 01.12.29 144A (i)	USD	1.140.000	1.020.967	0,19
Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01.03.30 144A (i)	USD	1.185.000	1.059.745	0,19
			4.848.618	0,88
Maschinen – Diversifiziert - 0,64 % (31. Dezember 2022: 0,51 %)				
Ingersoll Rand Inc, 5,700 %, 14.08.33	USD	155.000	163.990	0,03
John Deere Capital Corp, 0,450 %, 07.06.24	USD	2.185.000	2.138.292	0,39
Nordson Corp, 5,800 %, 15.09.33	USD	230.000	244.135	0,04
Toro Co, 6,625 %, 01.05.37	USD	930.000	988.520	0,18
			3.534.937	0,64
Medien - 5,18 % (31. Dezember 2022: 4,33 %)				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15.01.34 144A (i)	USD	4.150.000	3.372.402	0,61
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, 01.04.51	USD	765.000	497.579	0,09
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, 01.04.61	USD	450.000	280.491	0,05
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, 30.06.62	USD	2.805.000	1.764.660	0,32
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, 01.12.61	USD	4.335.000	2.995.581	0,55
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 6,384 %, 23.10.35	USD	6.430.000	6.527.053	1,19
CSC Holdings LLC, 3,375 %, 2/15/31 144A (i)	USD	940.000	685.799	0,12
CSC Holdings LLC, 4,125 %, 01.12.30 144A (i)	USD	400.000	304.300	0,06
CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01.12.30 144A (i)	USD	4.935.000	2.971.464	0,54
CSC Holdings LLC, 5,000 %, 11/15/31 144A (i)	USD	400.000	242.000	0,04
CSC Holdings LLC, 5,375 %, 01.02.28 144A (i)	USD	2.030.000	1.793.167	0,33
CSC Holdings LLC, 5,750 %, 1/15/30 144A (i)	USD	400.000	249.000	0,05
DISH DBS Corp, 5,125 %, 01.06.29	USD	1.350.000	695.776	0,13
DISH DBS Corp, 5,250 %, 01.12.26 144A (i)	USD	3.630.000	3.110.002	0,57
DISH DBS Corp, 5,750 %, 01.12.28 144A (i)	USD	1.205.000	961.108	0,17

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Medien – 5,18 % (31. Dezember 2022: 4,33 %) (Fortsetzung)				
DISH DBS Corp, 7,750 %, 01.07.26	USD	1.515.000	1.055.213	0,19
iHeartCommunications Inc, 5,250 %, 15.08.27 144A (i)	USD	545.000	433.043	0,08
Time Warner Cable LLC, 4,500 %, 15.09.42	USD	535.000	419.834	0,08
Time Warner Cable LLC, 5,875 %, 15.11.40	USD	85.000	76.942	0,01
			28.435.414	5,18
Bergbau - 1,94 % (31. Dezember 2022: 1,68 %)				
Anglo American Capital PLC, 5,500 %, 02.05.33 144A (i) (ii)	USD	5.495.000	5.551.080	1,01
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, 15.10.27 144A (i)	USD	4.310.000	3.662.832	0,67
FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 4,375 %, 01.04.31 144A (i) (ii)	USD	1.575.000	1.440.359	0,26
			10.654.271	1,94
Kommunalschuldverschreibungen - 0,17 % (31. Dezember 2022: 0,17 %)				
Tobacco Settlement Financing Corp/VA, 6,706 %, 01.06.46 *	USD	1.080.000	927.819	0,17
			927.819	0,17
Büro- und Geschäftsausstattung - 0,68 % (31. Dezember 2022: 0,49 %)				
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,250 %, 15.02.29	USD	570.000	521.205	0,09
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,276%, 01.12.28	USD	105.000	96.252	0,02
CDW LLC/CDW Finance Corp, 3,569 %, 01.02.31	USD	3.225.000	2.858.382	0,52
CDW LLC/CDW Finance Corp, 4,250 %, 01.04.28	USD	300.000	287.304	0,05
			3.763.143	0,68
Erdöl & -gas - 6,16 % (31. Dezember 2022: 5,97 %)				
Aker BP ASA, 6,000 %, 13.06.33 144A (i) (ii)	USD	9.005.000	9.353.555	1,70
Civitas Resources Inc, 8,625 %, 01.11.30 144A (i)	USD	225.000	238.662	0,04
Continental Resources Inc, 5,750 %, 15.01.31 144A (i)	USD	7.115.000	7.082.692	1,29
Devon Energy Corp, 4,500 %, 15.01.30	USD	416.000	399.410	0,07
Energian Israel Finance Ltd, 5,375 %, 30.03.28 144A (i) (ii)	USD	1.045.000	917.249	0,17
Energian Israel Finance Ltd, 5,875 %, 30.03.31 144A (i) (ii)	USD	1.375.000	1.158.710	0,21
EQT Corp, 7,000 %, 01.02.30	USD	3.330.000	3.573.889	0,65
Leviathan Bond Ltd, 6,500 %, 30.06.27 144A (i) (ii)	USD	410.000	385.908	0,07
Leviathan Bond Ltd, 6,750 %, 30.06.30 144A (i) (ii)	USD	450.000	409.568	0,07
Matador Resources Co, 6,875 %, 15.04.28 144A (i)	USD	235.000	238.364	0,04
Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15.01.24 (vi)	USD	3.105.000	209.588	0,04
Mesquite Energy Inc, 7,750 %, 15.06.24 (vi) *	USD	1.365.000	92.137	0,02
Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, 15.09.31	USD	20.000	22.751	0,00
Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, 15.07.30	USD	2.255.000	2.638.810	0,48
Ovintiv Inc, 6,500 %, 15.08.34	USD	1.645.000	1.748.747	0,32
Ovintiv Inc, 6,500 %, 01.02.38	USD	90.000	92.828	0,02
Ovintiv Inc, 6,625%, 15.08.37	USD	440.000	455.538	0,08
Ovintiv Inc, 7,200 %, 01.11.31	USD	60.000	65.108	0,01
Ovintiv Inc, 7,375 %, 01.11.31	USD	190.000	209.302	0,04
Ovintiv Inc, 8,125 %, 15.09.30	USD	240.000	269.994	0,05

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Erdöl & -gas – 6,16 % (31. Dezember 2022: 5,97 %) (Fortsetzung)				
Pertamina Persero PT, 6,450 %, 30.05.44 144A (i) (ii)	USD	2.150.000	2.344.215	0,43
Southwestern Energy Co, 4,750 %, 01.02.32	USD	215.000	198.921	0,04
Variable Energi ASA, 8,000 %, 15.11.32 144A (i) (ii)	USD	1.225.000	1.371.510	0,25
Viper Energy Inc, 7,375%, 01.11.31 144A (i)	USD	370.000	382.950	0,07
			33.860.406	6,16
Sonstige ABS - 0,33 % (31. Dezember 2022: 0,40 %)				
Castlelake Aircraft Securitization Trust, 5,300 %, 15.06.43 144A (i)	USD	261.000	200.480	0,04
Castlelake Aircraft Structured Trust, 3,967 %, 15.04.39 144A (i)	USD	287.379	250.397	0,05
Domino's Pizza Master Issuer LLC, 4,118 %, 25.07.47 144A (i)	USD	75.400	71.914	0,01
JOL Air Ltd, 3,967 %, 15.04.44 144A (i) (ii)	USD	792.253	720.834	0,13
MAPS Trust, 2,521 %, 15.06.46 144A (i)	USD	124.967	111.475	0,02
Merlin Aviation Holdings DAC, 4,500 %, 15.12.32 144A (i) (v)	USD	78.500	73.111	0,01
OneMain Financial Issuance Trust, 3,570 %, 14.03.33 144A (i)	USD	186.153	184.501	0,04
Wendy's Funding LLC, 3,884 %, 15.03.48 144A (i)	USD	187.994	177.346	0,03
			1.790.058	0,33
Verpackung - 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)				
Sealed Air Corp, 6,875 %, 15.07.33 144A (i)	USD	65.000	68.941	0,01
			68.941	0,01
Papier - 0,52 % (31. Dezember 2022: 0,47 %)				
Georgia-Pacific LLC, 7,750 %, 15.11.29	USD	2.470.000	2.849.203	0,52
			2.849.203	0,52
Pharmawerte - 1,94 % (31. Dezember 2022: 1,49 %)				
Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01.06.28 144A (i)	USD	2.425.000	1.460.439	0,26
Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, 01.02.36	USD	1.020.000	976.132	0,18
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15.09.29 (ii)	EUR	820.000	989.329	0,18
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,875 %, 15.09.31 (ii)	EUR	700.000	874.822	0,16
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01.10.26 (ii)	USD	510.000	472.209	0,09
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01.10.46 (ii)	USD	2.820.000	1.908.712	0,35
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, 09.05.27 (ii)	USD	1.780.000	1.704.350	0,31
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, 09.05.29 (ii)	USD	1.145.000	1.093.528	0,20
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,875 %, 15.09.29 (ii)	USD	625.000	673.601	0,12
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, 15.09.31 (ii)	USD	450.000	490.761	0,09
			10.643.883	1,94

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Pipelines - 2,35 % (31. Dezember 2022: 0,91 %)				
Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, 31.01.32	USD	205.000	174.667	0,03
Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, 01.03.31	USD	480.000	436.388	0,08
Cheniere Energy Partners LP, 5,950 %, 30.06.33 144A (i)	USD	2.895.000	2.972.412	0,54
DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, 15.02.32	USD	1.730.000	1.500.105	0,27
DCP Midstream Operating LP, 5,125 %, 15.05.29	USD	205.000	204.882	0,04
DCP Midstream Operating LP, 6,450 %, 03.11.36 144A (i)	USD	125.000	132.916	0,02
Energy Transfer LP, 5,750 %, 15.02.33	USD	1.475.000	1.520.694	0,28
EnLink Midstream LLC, 6,500 %, 01.09.30 144A (i)	USD	125.000	127.577	0,02
ONEOK Partners LP, 6,200 %, 15.09.43	USD	145.000	151.534	0,03
Targa Resources Corp, 6,125 %, 15.03.33	USD	670.000	705.402	0,13
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, 15.01.32	USD	590.000	537.630	0,10
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, 01.02.31	USD	135.000	131.140	0,02
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, 01.03.30	USD	135.000	134.976	0,03
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15.08.31 144A (i)	USD	1.940.000	1.709.151	0,31
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 6,250 %, 15.01.30 144A (i)	USD	455.000	452.538	0,08
Western Midstream Operating LP, 5,250 %, 01.02.50	USD	375.000	336.210	0,06
Western Midstream Operating LP, 5,300 %, 01.03.48	USD	665.000	578.700	0,11
Western Midstream Operating LP, 5,450 %, 01.04.44	USD	120.000	108.636	0,02
Western Midstream Operating LP, 5,500 %, 15.08.48	USD	90.000	80.262	0,02
Western Midstream Operating LP, 6,150 %, 01.04.33	USD	375.000	389.576	0,07
Western Midstream Operating LP, 6,350 %, 15.01.29	USD	490.000	511.761	0,09
			12.897.157	2,35
Immobilien - 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,70 %)				
Agile Group Holdings Ltd, 6,050 %, 13.10.25 (ii)	USD	1.030.000	124.252	0,02
Central China Real Estate Ltd, 7,250%, 16.07.24 (ii) (vi)	USD	820.000	37.513	0,01
Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 13.08.24 (ii) (vi)	USD	200.000	9.213	0,00
Central China Real Estate Ltd, 7,250 %, 28.04.25 (ii) (vi)	USD	190.000	8.423	0,00
Central China Real Estate Ltd, 7,500 %, 14.07.25 (ii) (vi)	USD	200.000	8.772	0,00
CIFI Holdings Group Co Ltd, 6,000 %, 16.07.25 (ii) (vi)	USD	400.000	26.000	0,01
Country Garden Holdings Co Ltd, 3,300 %, 12.01.31 (ii)	USD	800.000	64.344	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd, 9,375 %, 30.06.24 (ii) (vi)	USD	1.915.000	62.027	0,01
Kaisa Group Holdings Ltd, 9,950 %, 23.07.25 (ii) (vi)	USD	200.000	7.352	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd, 10,500 %, 15.01.25 (ii)	USD	400.000	13.084	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd, 11,250 %, 16.04.25 (ii) (vi)	USD	2.940.000	84.525	0,02
Kaisa Group Holdings Ltd, 11,700 %, 11.11.25 (ii) (vi)	USD	205.000	6.621	0,00
Logan Group Co Ltd, 4,250 %, 12.07.25 (ii) (vi)	USD	605.000	39.325	0,01
Logan Group Co Ltd, 4,850 %, 14.12.26 (ii) (vi)	USD	800.000	52.000	0,01
Shimao Group Holdings Ltd, 3,450 %, 11.01.31 (ii) (vi)	USD	1.015.000	38.063	0,01

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Immobilien – 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,70 %) (Fortsetzung)				
Shimao Group Holdings Ltd, 5,200 %, 16.01.27 (ii) (vi)	USD	200.000	6.454	0,00
Shimao Group Holdings Ltd, 5,600 %, 15.07.26 (ii) (vi)	USD	345.000	13.359	0,00
Shimao Group Holdings Ltd, 6,125 %, 21.02.24 (ii) (vi)	USD	200.000	8.000	0,00
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 05.08.29 (ii) (vi)	USD	405.000	31.149	0,01
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd, 4,750 %, 14.01.30 (ii) (vi)	USD	605.000	49.072	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,000 %, 30.09.25 144A (i) (ii)	USD	181.135	22.153	0,00
Sunac China Holdings Ltd, 6,250 %, 30.09.26 144A (i) (ii)	USD	181.135	19.231	0,00
Sunac China Holdings Ltd, 6,500 %, 30.09.27 144A (i) (ii)	USD	362.273	33.820	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 6,750 %, 30.09.28 144A (i) (ii)	USD	543.411	43.070	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 7,000 %, 30.09.29 144A (i) (ii)	USD	543.411	40.374	0,01
Sunac China Holdings Ltd, 7,250 %, 30.09.30 144A (i) (ii)	USD	255.274	16.272	0,00
Times China Holdings Ltd, 5,750 %, 14.01.27 (ii) (vi)	USD	200.000	4.016	0,00
Times China Holdings Ltd, 6,200 %, 22.03.26 (ii) (vi)	USD	820.000	18.450	0,00
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,350 %, 13.01.27 (ii) (vi)	USD	410.000	25.347	0,01
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,700 %, 20.02.25 (ii) (vi)	USD	660.000	41.111	0,01
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 7,850 %, 12.08.26 (ii) (vi)	USD	210.000	13.393	0,00
Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 8,300 %, 27.05.25 (ii) (vi)	USD	340.000	20.400	0,00
			987.185	0,18
Real Estate Investment Trusts - 1,68 % (31. Dezember 2022: 2,89 %)				
American Tower Corp, 5,900 %, 15.11.33	USD	1.595.000	1.688.666	0,31
Corporate Office Properties LP, 2,750 %, 15.04.31	USD	320.000	258.653	0,05
EPR Properties, 3,600 %, 15.11.31	USD	450.000	373.215	0,07
GLP Capital LP/GLP Financing II Inc, 3,250 %, 15.01.32	USD	625.000	527.658	0,09
GLP Capital LP/GLP Financing II Inc, 6,750 % 01.12.33	USD	125.000	134.854	0,02
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01.12.26 144A (i)	USD	1.085.000	1.044.160	0,19
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,500 %, 01.09.26 144A (i)	USD	895.000	866.292	0,16
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,625 %, 15.06.25 144A (i)	USD	770.000	756.332	0,14
Weyerhaeuser Co, 6,875 %, 15.12.33	USD	340.000	373.689	0,07
Weyerhaeuser Co, 6,950 %, 01.10.27	USD	825.000	882.468	0,16
Weyerhaeuser Co, 7,375 %, 15.03.32	USD	1.989.000	2.308.162	0,42
			9.214.149	1,68
Einzelhandel - 0,52 % (31. Dezember 2022: 0,10 %)				
Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15.11.29 144A (i)	USD	380.000	351.728	0,06
Dillard's Inc, 7,000 %, 01.12.28	USD	200.000	208.126	0,04
Dillard's Inc, 7,750 %, 15.07.26	USD	130.000	135.656	0,02
Lithia Motors Inc, 3,875 %, 01.06.29 144A (i)	USD	1.875.000	1.700.100	0,31
Lithia Motors Inc, 4,375 %, 15.01.31 144A (i)	USD	150.000	136.354	0,03

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Einzelhandel – 0,52 % (31. Dezember 2022: 0,10 %) (Fortsetzung)				
Marks & Spencer PLC, 7,125 %, 01.12.37 144A (i) (ii)	USD	325.000	326.356	0,06
			2.858.320	0,52
Halbleiter - 3,82 % (31. Dezember 2022: 1,91 %)				
Broadcom Inc, 3,137 %, 15.11.35 144A (i)	USD	1.140.000	935.922	0,17
Broadcom Inc, 3,469 %, 15.04.34 144A (i)	USD	1.075.000	935.255	0,17
Broadcom Inc, 4,150 %, 15.11.30	USD	885.000	845.335	0,15
Broadcom Inc, 4,150 %, 15.04.32 144A (i)	USD	340.000	320.509	0,06
Broadcom Inc, 4,926 %, 15.05.37 144A (i)	USD	3.890.000	3.764.471	0,68
Entegris Escrow Corp, 4,750 %, 15.04.29 144A (i)	USD	2.060.000	1.984.632	0,36
Marvell Technology Inc, 5,750 %, 15.02.29	USD	940.000	971.206	0,18
Marvell Technology Inc, 5,950 %, 15.09.33	USD	4.020.000	4.262.767	0,78
Micron Technology Inc, 5,875 %, 09.02.33	USD	1.735.000	1.803.336	0,33
Micron Technology Inc, 5,875%, 9/15/33	USD	4.690.000	4.877.986	0,89
SK Hynix Inc, 6,375 %, 17.01.28 144A (i) (ii)	USD	295.000	304.518	0,05
			21.005.937	3,82
Staatsanleihen - 17,27 % (31. Dezember 2022: 26,81 %)				
Indonesia Treasury Bond, 6,375 %, 15.08.28 (ii)*	IDR	21.774.000.000	1.409.335	0,25
Indonesia Treasury Bond, 6,875 %, 15.04.29 (ii)*	IDR	18.413.000.000	1.212.173	0,22
Mexican Bonos, 7,500 %, 26.05.33 (ii)	MXN	49.185.200	2.630.404	0,48
Republic of South Africa Government Bond, 8,875 %, 28.02.35 (ii)	ZAR	57.790.000	2.665.529	0,48
Republic of Uzbekistan International Bond, 7,850 %, 12.10.28 144A (i) (ii)	USD	415.000	433.418	0,08
United States Treasury Bill, 5,201 %, 6/20/24	USD	8.430.000	8.226.944	1,50
United States Treasury Bill, 5,370 %, 5/23/24	USD	5.600.000	5.483.628	1,00
United States Treasury Bill, 5,406 %, 09.05.24	USD	2.620.000	2.570.599	0,47
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 15.08.53	USD	4.820.000	4.871.966	0,89
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 15.08.43	USD	18.185.000	18.562.907	3,38
United States Treasury Note/Bond, 4,625%, 30.06.25	USD	46.665.000	46.776.194	8,52
			94.843.097	17,27
Telekommunikation - 2,57 % (31. Dezember 2022: 1,96 %)				
Cincinnati Bell Telephone Co LLC, 6,300 %, 01.12.28	USD	40.000	33.363	0,01
CommScope Inc, 4,750 %, 01.09.29 144A (i)	USD	4.230.000	2.840.046	0,52
SoftBank Group Corp, 4,625 %, 06.07.28 (ii)	USD	810.000	738.848	0,13
Sprint Capital Corp, 8,750 %, 15.03.32	USD	1.750.000	2.159.960	0,39
Telecom Italia Capital SA, 6,375 %, 15.11.33 (ii)	USD	1.487.000	1.454.446	0,27
T-Mobile USA Inc, 5,750 %, 15.01.34	USD	6.480.000	6.872.960	1,25
			14.099.623	2,57
Transportdienstleister - 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Rand Parent LLC, 8,500 %, 15.02.30 144A (i)	USD	425.000	406.490	0,07
			406.490	0,07

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Speditions- und Leasinggeschäft - 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
GATX Corp, 5,450 %, 15.09.33	USD	1.470.000	1.479.059	0,27
GATX Corp, 6,050 %, 15.03.34	USD	70.000	72.694	0,01
SMBC Aviation Capital Finance DAC, 5,450 %, 03.05.28 144A (i) (ii)	USD	885.000	889.890	0,16
			2.441.643	0,44
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**487.596.735**	**88,79**
WANDELANLEIHEN – 4,81 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 5,05 %)				
Fluggesellschaften – 0,39 % (31. Dezember 2022: 0,45 %)				
Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01.05.25	USD	2.115.000	2.137.208	0,39
			2.137.208	0,39
Biotechnologie - 0,62 % (31. Dezember 2022: 0,59 %)				
BioMarin Pharmaceutical Inc, 0,599 %, 01.08.24	USD	1.190.000	1.172.864	0,21
BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 15.05.27	USD	1.520.000	1.560.888	0,29
Livongo Health Inc, 0,875 %, 01.06.25	USD	690.000	645.097	0,12
			3.378.849	0,62
Elektrowerte – 0,25 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
PPL Capital Funding Inc, 2,875 %, 15.03.28 144A (i)	USD	1.445.000	1.399.482	0,25
			1.399.482	0,25
Unterhaltung – 0,08 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)				
Penn Entertainment Inc, 2,750 %, 15.05.26	USD	345.000	446.775	0,08
			446.775	0,08
Gesundheit - 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,51 %)				
Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01.06.27	USD	3.910.000	3.213.629	0,59
			3.213.629	0,59
Internet - 0,67 % (31. Dezember 2022: 0,49 %)				
Etsy Inc, 0,125 %, 01.09.27	USD	295.000	250.927	0,04
Etsy Inc, 0,250 %, 15.06.28	USD	935.000	748.561	0,14
Spotify USA Inc, Zero Coupon Bond, 15.03.26	USD	800.000	704.000	0,13
Uber Technologies Inc, Zero Coupon Bond, 12/15/25	USD	1.945.000	1.977.790	0,36
			3.681.278	0,67
Freizeit - 0,18 % (31. Dezember 2022: 0,23 %)				
NCL Corp Ltd, 1,125 %, 15.02.27 (ii)	USD	1.085.000	997.527	0,18
			997.527	0,18
Medien - 1,70 % (31. Dezember 2022: 2,39 %)				
DISH Network Corp, 2,375 %, 15.03.24	USD	2.695.000	2.668.050	0,49
DISH Network Corp, 3,375 %, 15.08.26	USD	12.556.000	6.654.680	1,21
			9.322.730	1,70

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
WANDELANLEIHEN (Fortsetzung)				
Immobilien – 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Sunac China Holdings Ltd, 1,000 %, 30.09.32 144A (i) (ii)	USD	223.909	16.793	0,00
			16.793	0,00
Software - 0,33 % (31. Dezember 2022: 0,31 %)				
Splunk Inc, 1,125 %, 15.06.27	USD	745.000	721.533	0,13
Unity Software Inc, Zero Coupon Bond, 15.11.26	USD	1.325.000	1.101.075	0,20
			1.822.608	0,33
WANDELANLEIHEN, GESAMT			**26.416.879**	**4,81**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**514.013.614**	**93,60**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN – 0,07 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 0,07 %)				
Wohnungsbau - 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Hovnanian Enterprises Inc, 7,625 % (iv)	USD	598	11.063	0,00
			11.063	0,00
Real Estate Investment Trusts - 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,07 %)				
Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iv)	USD	74	73.242	0,01
Prologis Inc, 8,540 % (iv) *	USD	5.429	298.595	0,06
			371.837	0,07
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN, GESAMT			**382.900**	**0,07**
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN – 0,54 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 1,76 %)				
Banken - 0,41 % (31. Dezember 2022: 0,70 %)				
Bank of America Corp, 7,250 % (iv)	USD	1.233	1.486.110	0,27
Wells Fargo & Co, 7,500 % (iv)	USD	648	774.762	0,14
			2.260.872	0,41
Software - 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)				
Clarivate PLC, 5,250 %, 01.06.24	USD	19.335	733.183	0,13
			733.183	0,13
WANDELBARE VORZUGSAKTIEN, GESAMT			**2.994.055**	**0,54**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN – 0,45 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 0,28 %)				
Gewerbliche Dienste – 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Clarivate PLC	USD	894	8.278	0,00
			8.278	0,00
Medien - 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)				
ALTICE USA INC	USD	207.260	673.595	0,13
			673.595	0,13
Erdöl & -gas - 0,16 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)				
Battalion Oil Corp	USD	8.641	83.040	0,01
Diamondback Energy Inc	USD	5.193	805.331	0,15
			888.371	0,16
Pharmawerte - 0,16 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
AbbVie Inc	USD	5.669	878.525	0,16
			878.525	0,16
STAMMAKTIEN, GESAMT			**2.448.769**	**0,45**
ANLAGEFONDS – 2,09 % des NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 2,08 %)				
Gewerbliche Dienste – 2,09 % (31. Dezember 2022: 2,08 %)				
Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (ii)	USD	1.640	11.489.676	2,09
			11.489.676	2,09
INVESTMENTFONDS, GESAMT			**11.489.676**	**2,09**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: USD 570.845.981)			**531.329.014**	**96,75**

FINANZDERIVATE – 0,82 % (31. Dezember 2022: (0,08 %))

Offene Devisenterminkontrakte – 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Fälligkeits-datum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
3/20/24	USD 1.562.171	EUR 1.425.000	Bank of America	(16.898)	(0,00 %)
1. Februar 2024	USD 3.208	SGD 4.246	Brown Brothers Harriman	(11)	(0,00 %)
1. Februar 2024	USD 1.641	EUR 1.490	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)
1. Februar 2024	USD 1.124	SGD 1.488	Brown Brothers Harriman	(4)	(0,00 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinns/ (Verlustes) USD	% des Nettovermögens
1. Februar 2024	USD 647	EUR 587	Brown Brothers Harriman	(2)	(0,00 %)
1. Februar 2024	SGD 15	USD 12	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1. Februar 2024	USD 35	EUR 32	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1. Februar 2024	SGD 71	USD 53	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1. Februar 2024	USD 132	SGD 175	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1. Februar 2024	EUR 316	USD 348	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1. Februar 2024	SGD 6.124	USD 4.626	Brown Brothers Harriman	16	0,00 %
1. Februar 2024	SGD 8.242	USD 6.227	Brown Brothers Harriman	22	0,00 %
1. Februar 2024	EUR 15.000	USD 16.523	Brown Brothers Harriman	47	0,00 %
1. Februar 2024	EUR 18.562	USD 20.447	Brown Brothers Harriman	58	0,00 %
1. März 2024	USD 8.376	CHF 6.982	Brown Brothers Harriman	80	0,00 %
1. März 2024	CHF 6.982	USD 8.016	Brown Brothers Harriman	280	0,00 %
1. März 2024	USD 1.793.715	GBP 1.404.406	Brown Brothers Harriman	3.379	0,00 %
1. März 2024	USD 578.372	AUD 842.227	Brown Brothers Harriman	3.679	0,00 %
1. März 2024	USD 567.496	EUR 510.400	Brown Brothers Harriman	3.682	0,00 %
1. März 2024	USD 860.888	EUR 774.274	Brown Brothers Harriman	5.586	0,00 %
1. März 2024	USD 2.751.128	SGD 3.617.082	Brown Brothers Harriman	9.045	0,00 %
1. März 2024	EUR 510.400	USD 551.605	Brown Brothers Harriman	12.209	0,00 %
1. März 2024	USD 2.251.034	EUR 2.024.557	Brown Brothers Harriman	14.607	0,00 %
1. März 2024	EUR 774.274	USD 836.782	Brown Brothers Harriman	18.520	0,00 %
1. März 2024	AUD 842.227	USD 553.474	Brown Brothers Harriman	21.219	0,00 %
1. März 2024	USD 3.942.428	EUR 3.545.780	Brown Brothers Harriman	25.582	0,00 %
1. März 2024	GBP 1.404.406	USD 1.759.537	Brown Brothers Harriman	30.800	0,01 %
1. März 2024	USD 4.884.449	EUR 4.393.024	Brown Brothers Harriman	31.694	0,01 %
1. März 2024	SGD 3.617.082	USD 2.697.931	Brown Brothers Harriman	44.152	0,01 %

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1. März 2024	EUR 2.024.557	USD 2.188.688	Brown Brothers Harriman	47.739	0,01 %
1. März 2024	USD 21.280.056	SGD 27.978.231	Brown Brothers Harriman	69.965	0,01 %
1. März 2024	EUR 3.545.780	USD 3.821.889	Brown Brothers Harriman	94.957	0,02 %
1. März 2024	USD 15.952.260	EUR 14.347.302	Brown Brothers Harriman	103.511	0,02 %
1. März 2024	EUR 4.393.024	USD 4.744.588	Brown Brothers Harriman	108.166	0,02 %
1. März 2024	EUR 14.347.302	USD 15.509.675	Brown Brothers Harriman	339.074	0,06 %
1. März 2024	SGD 27.978.231	USD 20.869.583	Brown Brothers Harriman	340.508	0,06 %
1/31/24	USD 20.867.915	SGD 27.978.231	Brown Brothers Harriman	(371.642)	(0,07 %)
1/31/24	USD 15.507.877	EUR 14.347.302	Brown Brothers Harriman	(359.891)	(0,07 %)
1/31/24	USD 4.744.020	EUR 4.393.024	Brown Brothers Harriman	(114.558)	(0,02 %)
1/31/24	USD 3.821.399	EUR 3.545.780	Brown Brothers Harriman	(100.147)	(0,02 %)
1/31/24	EUR 14.347.302	USD 15.952.260	Brown Brothers Harriman	(84.493)	(0,02 %)
1/31/24	USD 2.188.435	EUR 2.024.557	Brown Brothers Harriman	(50.676)	(0,01 %)
1/31/24	USD 2.697.715	SGD 3.617.082	Brown Brothers Harriman	(48.177)	(0,01 %)
1/31/24	SGD 27.978.231	USD 21.280.056	Brown Brothers Harriman	(40.499)	(0,01 %)
1/31/24	USD 1.759.398	GBP 1.404.406	Brown Brothers Harriman	(31.240)	(0,01 %)
1/31/24	EUR 4.393.024	USD 4.884.449	Brown Brothers Harriman	(25.871)	(0,00 %)
1/31/24	USD 553.373	AUD 842.227	Brown Brothers Harriman	(21.894)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 3.545.780	USD 3.942.428	Brown Brothers Harriman	(20.881)	(0,00 %)
1/31/24	USD 836.684	EUR 774.274	Brown Brothers Harriman	(19.645)	(0,00 %)
1/31/24	USD 551.541	EUR 510.400	Brown Brothers Harriman	(12.950)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 2.024.557	USD 2.251.034	Brown Brothers Harriman	(11.923)	(0,00 %)
1/31/24	USD 917.985	EUR 838.718	Brown Brothers Harriman	(9.616)	(0,00 %)
1/31/24	USD 350.271	EUR 323.932	Brown Brothers Harriman	(7.990)	(0,00 %)
1/31/24	SGD 3.617.082	USD 2.751.128	Brown Brothers Harriman	(5.236)	(0,00 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	EUR 774.274	USD 860.888	Brown Brothers Harriman	(4.560)	(0,00 %)
1/31/24	AUD 842.227	USD 578.372	Brown Brothers Harriman	(3.105)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 1.404.406	USD 1.793.715	Brown Brothers Harriman	(3.077)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 510.400	USD 567.496	Brown Brothers Harriman	(3.006)	(0,00 %)
1/31/24	USD 167.705	EUR 152.327	Brown Brothers Harriman	(766)	(0,00 %)
1/31/24	USD 8.015	CHF 6.982	Brown Brothers Harriman	(307)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 96.262	USD 106.624	Brown Brothers Harriman	(160)	(0,00 %)
1/31/24	CHF 6.982	USD 8.376	Brown Brothers Harriman	(55)	(0,00 %)
1/31/24	CHF 203	USD 235	Brown Brothers Harriman	7	0,00 %
1/31/24	AUD 25.835	USD 17.376	Brown Brothers Harriman	270	0,00 %
1/31/24	CHF 6.779	USD 7.780	Brown Brothers Harriman	300	0,00 %
1/31/24	SGD 71.585	USD 54.035	Brown Brothers Harriman	308	0,00 %
1/31/24	EUR 52.853	USD 57.803	Brown Brothers Harriman	651	0,00 %
1/31/24	EUR 113.234	USD 123.840	Brown Brothers Harriman	1.395	0,00 %
1/31/24	EUR 333.435	USD 364.665	Brown Brothers Harriman	4.106	0,00 %
1/31/24	SGD 860.237	USD 647.537	Brown Brothers Harriman	5.509	0,00 %
1/31/24	EUR 510.400	USD 551.541	Brown Brothers Harriman	12.950	0,00 %
1/31/24	EUR 774.274	USD 836.684	Brown Brothers Harriman	19.645	0,00 %
1/31/24	AUD 816.392	USD 535.997	Brown Brothers Harriman	21.624	0,00 %
1/31/24	GBP 1.404.406	USD 1.759.398	Brown Brothers Harriman	31.240	0,01 %
1/31/24	SGD 3.545.497	USD 2.643.680	Brown Brothers Harriman	47.870	0,01 %
1/31/24	EUR 1.971.705	USD 2.130.632	Brown Brothers Harriman	50.026	0,01 %
1/31/24	EUR 4.271.263	USD 4.615.544	Brown Brothers Harriman	108.369	0,02 %
1/31/24	EUR 4.545.351	USD 4.911.725	Brown Brothers Harriman	115.323	0,02 %
1/31/24	EUR 14.337.799	USD 15.493.483	Brown Brothers Harriman	363.774	0,07 %

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	SGD 27.117.994	USD 20.220.378	Brown Brothers Harriman	366.133	0,07 %
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				2.478.078	0,44 %
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten				(1.369.285)	(0,24 %)
Nicht realisierter Nettogewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				**1.108.793**	**0,20 %**

Futures - 0,62 % (31. Dezember 2022: (0,08 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Kontrahent	Engagement	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	% des Nettovermögens
(1.029)	US 10 Year Ultra March 2024 Futures	JP Morgan	117.598.508	(3.839.570)	(0,70 %)
441	US 2 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	90.010.596	797.505	0,15 %
88	US 5 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	9.391.938	180.125	0,03 %
666	US 10 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	72.999.844	2.185.312	0,40 %
133	US Long Bond March 2024 Futures	JP Morgan	15.566.966	1.049.722	0,19 %
274	US Ultra Bond March 2024 Futures	JP Morgan	33.614.416	2.990.271	0,55 %
Nicht realisierter Gewinn aus Futures				7.202.935	1,32 %
Nicht realisierter Verlust aus Futures				(3.839.570)	(0,70 %)
Nicht realisierter Nettogewinn auf Futures				**3.363.365**	**0,62 %**

	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**541.010.027**	**98,51**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(5.208.855)**	**(0,95)**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**535.801.172**	**97,56**
Bankguthaben	7.210.183	1,31
Sonstige Vermögenswerte	9.052.525	1,65
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(2.886.519)	(0,52)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**549.177.361**	**100,00**

(i) Wertpapiere, die nach Rule 144A (i) des U.S. Securities Act aus dem Jahr 1933 nicht registriert werden müssen. Sie können im Rahmen von registrierungsfreien Transaktionen veräußert werden, in der Regel an entsprechend qualifizierte institutionelle Anleger.
(ii) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(iii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(iv) Ewige Anleihen.
(v) Stufenzinsanleihe. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(vi) Wertpapier mit Zahlungsverzug.
* Nicht börsennotierte Wertpapiere.

Sonstige Informationen:
Die zuvor genannten langfristigen Wertpapiere werden, sofern nicht anders angegeben, an geregelten Märkten gehandelt.

Abkürzungen:

AUD:	Australischer Dollar
CHF:	Schweizer Franken
EUR:	Euro
GBP:	Britisches Pfund
IDR:	Indonesische Rupiah
MXN:	Mexikanischer Peso
SGD:	Singapur-Dollar
USD:	US-Dollar
ZAR:	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögen**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	38,81
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	52,65
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an offiziellen Börsen notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden.	4,19
Finanzderivate	0,81
Umlaufvermögen	3,54
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 94,80 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 94,57 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 89,61 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 88,95 %)				
Werbung - 0,69 % (31. Dezember 2022: 0,18 %)				
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp, 5,000 %, 15.08.27 144A (i)	USD	5.000	4.833	0,07
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp, 7,375 %, 15.02.31 144A (i)	USD	5.000	5.251	0,08
Stagwell Global LLC, 5,625 %, 15.08.29 144A (i)	USD	40.000	36.884	0,54
			46.968	0,69
Luft- und Raumfahrt/Verteidigung - 2,09 % (31. Dezember 2022: 2,12 %)				
Bombardier Inc, 6,000 %, 15.02.28 144A (i)	USD	10.000	9.743	0,14
Bombardier Inc, 7,125 %, 15.06.26 144A (i)	USD	35.000	34.837	0,51
Bombardier Inc, 7,875 %, 15.04.27 144A (i)	USD	5.000	5.001	0,08
Bombardier Inc, 8,750 %, 15.11.30 144A (i)	USD	5.000	5.324	0,08
TransDigm Inc, 6,250 %, 15.03.26	USD	15.000	14.974	0,22
TransDigm Inc, 6,750 %, 15.08.28 144A (i)	USD	30.000	30.692	0,45
TransDigm Inc, 6,875 %, 15.12.30 144A (i)	USD	20.000	20.600	0,30
TransDigm Inc, 7,125 %, 01.12.31 144A (i)	USD	20.000	20.958	0,31
			142.129	2,09
Fluggesellschaften - 1,39 % (31. Dezember 2022: 1,28 %)				
Allegiant Travel Co, 7,250 %, 15.08.27 144A (i)	USD	10.000	9.784	0,15
American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, 20.04.29 144A (i) (ii)	USD	70.000	68.233	1,00
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd/HawaiianMiles Loyalty Ltd, 5,750 %, 20.01.26 144A (i) (ii)	USD	10.000	9.422	0,14
Spirit Loyalty Cayman Ltd/Spirit IP Cayman Ltd, 8,000 %, 20.09.25 144A (i) (ii)	USD	5.000	3.596	0,05
Spirit Loyalty Cayman Ltd/Spirit IP Cayman Ltd, 8,000 %, 20.09.25 144A (i) (ii)	USD	5.000	3.596	0,05
			94.631	1,39
Bekleidung - 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Crocs Inc, 4,125 %, 15.08.31 144A (i)	USD	5.000	4.231	0,06
			4.231	0,06
Autos - 2,49 % (31. Dezember 2022: 1,96 %)				
Allison Transmission Inc, 4,750 %, 01.10.27 144A (i)	USD	25.000	24.157	0,35
American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, 01.10.29	USD	10.000	8.835	0,13
Ford Motor Co, 4,346 %, 12.08.2026	USD	55.000	53.599	0,79
General Motors Financial Co Inc, 5,700 % (iii) (iv)	USD	25.000	23.087	0,34
General Motors Financial Co Inc, 5,750 % (iii) (iv)	USD	45.000	39.915	0,59
General Motors Financial Co Inc, 6,500 % (iii) (iv)	USD	20.000	18.199	0,27
Wheel Pros Inc, 6,500 %, 15.05.29 144A (i)	USD	5.000	1.525	0,02
			169.317	2,49
Baumaterialien - 0,91 % (31. Dezember 2022: 0,66 %)				
ACProducts Holdings Inc, 6,375 %, 15.05.29 144A (i)	USD	5.000	3.702	0,05
Builders FirstSource Inc, 4,250 %, 01.02.32 144A (i)	USD	5.000	4.510	0,07

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Baumaterialien – 0,91 % (31. Dezember 2022: 0,66 %) (Fortsetzung)				
Builders FirstSource Inc, 5,000 %, 01.03.30 144A (i)	USD	10.000	9.656	0,14
Camelot Return Merger Sub Inc, 8,750 %, 01.08.28 144A (i)	USD	15.000	15.225	0,22
MIWD Holdco II LLC/MIWD Finance Corp, 5,500 %, 01.02.30 144A (i)	USD	10.000	8.850	0,13
Standard Industries Inc, 4,375 %, 15.07.30 144A (i)	USD	10.000	9.184	0,14
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp, 7,250 %, 15.01.31 144A (i)	USD	10.000	10.537	0,16
			61.664	0,91
Chemiewerte - 0,46 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)				
Ashland Inc, 3,375 %, 01.09.31 144A (i)	USD	5.000	4.310	0,06
ASP Unifrax Holdings Inc, 5,250 %, 30.09.28 144A (i)	USD	25.000	18.053	0,27
Chemours Co, 4,625 %, 15.11.29 144A (i)	USD	10.000	8.779	0,13
			31.142	0,46
Gewerbliche Dienste - 1,57 % (31. Dezember 2022: 1,40 %)				
ADT Security Corp, 4,125 %, 01.08.29 144A (i)	USD	35.000	32.209	0,48
Gartner Inc, 3,750 %, 01.10.30 144A (i)	USD	20.000	17.679	0,26
Neptune Bidco US Inc, 9,290 %, 15.04.29 144A (i)	USD	30.000	27.975	0,41
Paysafe Finance PLC/Paysafe Holdings US Corp, 4,000 %, 15.06.29 144A (i) (ii)	USD	10.000	8.825	0,13
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance Inc, 3,375 %, 31.08.27 144A (i)	USD	5.000	4.636	0,07
Sabre GLBL Inc, 11,250 %, 15.12.27 144A (i)	USD	5.000	4.912	0,07
VT Topco Inc, 8,500 %, 15.08.30 144A (i)	USD	10.000	10.404	0,15
			106.640	1,57
Computer - 1,96 % (31. Dezember 2022: 0,57 %)				
NCR Atleos Corp, 9,500 %, 01.04.29 144A (i)	USD	30.000	31.875	0,47
NCR Voyix Corp, 5,000 %, 01.10.28 144A (i)	USD	40.000	37.811	0,56
NCR Voyix Corp, 5,125 %, 15.04.29 144A (i)	USD	5.000	4.753	0,07
Presidio Holdings Inc, 8,250 %, 01.02.28 144A (i)	USD	10.000	10.103	0,15
Seagate HDD Cayman, 4,091 %, 06.01.29 (ii)	USD	15.000	13.900	0,20
Seagate HDD Cayman, 4,750 %, 01.01.25 (ii)	USD	20.000	19.833	0,29
Seagate HDD Cayman, 8,250 %, 15.12.29 144A (i) (ii)	USD	10.000	10.785	0,16
Western Digital Corp, 2,850 %, 01.02.29	USD	5.000	4.304	0,06
			133.364	1,96
Kosmetika/Körperpflege – 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,31 %)				
Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 4,750 %, 15.01.29 144A (i)	USD	15.000	14.307	0,21
Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC, 6,625 %, 15.07.30 144A (i)	USD	15.000	15.410	0,23
			29.717	0,44
Vertrieb/Großhandel - 0,38 % (31. Dezember 2022: 0,09 %)				
Resideo Funding Inc, 4,000 %, 01.09.29 144A (i)	USD	30.000	26.175	0,38
			26.175	0,38

Vermögensaufstellung				**Zum 31. Dezember 2023**
		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Elektrowerte - 0,57 % (31. Dezember 2022: 1,53 %)				
Calpine Corp, 4,500 %, 15.02.28 144A (i)	USD	20.000	19.023	0,28
PG&E Corp, 5,000 %, 01.07.28	USD	15.000	14.595	0,21
Talen Energy Supply LLC, 8,625 %, 01.06.30 144A (i)	USD	5.000	5.312	0,08
			38.930	0,57
Elektrische Bauteile und Geräte - 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,29 %)				
Energizer Holdings Inc, 4,375 %, 31.03.29 144A (i)	USD	60.000	53.705	0,79
			53.705	0,79
Elektronik - 0,81 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)				
Sensata Technologies BV, 5,000 %, 01.10.25 144A (i) (ii)	USD	20.000	20.024	0,29
Sensata Technologies Inc, 3,750 %, 15.02.31 144A (i)	USD	40.000	35.229	0,52
			55.253	0,81
Bau und Maschinenbau - 0,15 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)				
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 6,000 %, 01.02.26 144A (i)	USD	10.000	9.995	0,15
			9.995	0,15
Unterhaltung - 1,52 % (31. Dezember 2022: 2,02 %)				
Caesars Entertainment Inc, 6,250 %, 01.07.25 144A (i)	USD	15.000	15.041	0,22
Cinemark USA Inc, 5,250 %, 15.07.28 144A (i)	USD	10.000	9.174	0,13
Everi Holdings Inc, 5,000 %, 15.07.29 144A (i)	USD	5.000	4.539	0,07
Light & Wonder International Inc, 7,000 %, 15.05.28 144A (i)	USD	10.000	10.102	0,15
Light & Wonder International Inc, 7,250 %, 15.11.29 144A (i)	USD	35.000	35.837	0,52
Light & Wonder International Inc, 7,500 %, 01.09.31 144A (i)	USD	5.000	5.215	0,08
SeaWorld Parks & Entertainment Inc, 5,250 %, 15.08.29 144A (i)	USD	10.000	9.348	0,14
Speedway Motorsports LLC/Speedway Funding II Inc, 4,875 %, 01.11.27 144A (i)	USD	15.000	14.081	0,21
			103.337	1,52
Umweltkontrolle - 1,13 % (31. Dezember 2022: 0,43 %)				
Clean Harbors Inc, 6,375 %, 01.02.31 144A (i)	USD	5.000	5.080	0,07
Covanta Holding Corp, 4,875 %, 01.12.29 144A (i)	USD	40.000	34.948	0,51
GFL Environmental Inc, 4,000 %, 01.08.28 144A (i)	USD	20.000	18.488	0,27
GFL Environmental Inc, 6,750 %, 15.01.31 144A (i)	USD	5.000	5.151	0,08
Madison IAQ LLC, 4,125 %, 30.06.28 144A (i)	USD	5.000	4.546	0,07
Madison IAQ LLC, 5,875 %, 30.06.29 144A (i)	USD	10.000	8.811	0,13
			77.024	1,13
Finanzen - 5,91 % (31. Dezember 2022: 4,95 %)				
Aircastle Ltd, 5,250 % 144A (i) (ii) (iii) (iv)	USD	5.000	4.287	0,06
Aircastle Ltd, 6,500 %, 18.07.28 144A (i) (ii)	USD	10.000	10.197	0,15
Coinbase Global Inc, 3,375 %, 01.10.28 144A (i)	USD	5.000	4.219	0,06
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 6,500 %, 15.09.24 144A (i) (ii)	USD	15.725	14.782	0,22
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,000 % 01.02.26 144A (i)	USD	15.000	14.669	0,22
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,125 %, 15.12.30 144A (i)	USD	15.000	13.562	0,20
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 5,750 %, 15.11.31 144A (i)	USD	50.000	46.620	0,68

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Finanzen – 5,91 % (31. Dezember 2022: 4,95 %) (Fortsetzung)				
Nationstar Mortgage Holdings Inc, 6,000 %, 15.01.27 144A (i)	USD	5.000	4.963	0,07
Navient Corp, 4,875 %, 15.03.28	USD	15.000	13.936	0,20
Navient Corp, 5,625 %, 01.08.33	USD	35.000	28.712	0,42
NFP Corp, 6,875 %, 15.08.28 144A (i)	USD	10.000	10.166	0,15
NFP Corp, 7,500 %, 01.10.30 144A (i)	USD	5.000	5.321	0,08
NFP Corp, 8,500 %, 01.10.31 144A (i)	USD	10.000	10.839	0,16
OneMain Finance Corp, 3,500 %, 15.01.27	USD	10.000	9.254	0,14
OneMain Finance Corp, 4,000 %, 15.09.30	USD	30.000	25.673	0,38
OneMain Finance Corp, 5,375 %, 15.11.29	USD	5.000	4.682	0,07
OneMain Finance Corp, 7,125%, 15.03.26	USD	35.000	35.658	0,52
PennyMac Financial Services Inc, 7,875 %, 15.12.29 144A (i)	USD	15.000	15.441	0,23
Provident Funding Associates LP/PFG Finance Corp, 6,375 %, 15.06.25 144A (i)	USD	20.000	18.350	0,27
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 3,875 %, 01.03.31 144A (i)	USD	10.000	8.795	0,13
Rocket Mortgage LLC/Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 4,000 %, 15.10.33 144A (i)	USD	120.000	101.943	1,50
			402.069	5,91
Nahrungsmittel - 0,95 % (31. Dezember 2022: 2,06 %)				
Lamb Weston Holdings Inc, 4,125 %, 31.01.30 144A (i)	USD	10.000	9.219	0,14
Lamb Weston Holdings Inc, 4,375 %, 31.01.32 144A (i)	USD	15.000	13.684	0,20
Lamb Weston Holdings Inc, 4,875 %, 15.05.28 144A (i)	USD	10.000	9.780	0,14
Post Holdings Inc, 4,625 %, 15.04.30 144A (i)	USD	25.000	22.996	0,34
Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 4,625 %, 01.03.29 144A (i)	USD	10.000	8.652	0,13
			64.331	0,95
Lebensmitteldienste - 0,07 % (31. Dezember 2022: 0,11 %)				
Aramark Services Inc, 5,000 %, 01.02.28 144A (i)	USD	5.000	4.850	0,07
			4.850	0,07
Gesundheit - 4,16 % (31. Dezember 2022: 2,72 %)				
Bausch & Lomb Escrow Corp, 8,375 %, 01.10.28 144A (i)	USD	35.000	36.923	0,54
CHS/Community Health Systems Inc, 5,250 %, 15.05.30 144A (i)	USD	35.000	29.272	0,43
DaVita Inc, 3,750 %, 15.02.31 144A (i)	USD	40.000	32.854	0,48
Encompass Health Corp, 4,750 %, 01.02.30	USD	25.000	23.543	0,34
Garden Spinco Corp, 8,625 %, 20.07.30 144A (i)	USD	10.000	10.681	0,16
Hologic Inc, 3,250 %, 15.02.29 144A (i)	USD	5.000	4.533	0,07
Hologic Inc, 4,625 %, 01.02.28 144A (i)	USD	10.000	9.599	0,14
LifePoint Health Inc, 5,375 %, 15.01.29 144A (i)	USD	30.000	22.184	0,32
Medline Borrower LP, 3,875 %, 01.04.29 144A (i)	USD	15.000	13.562	0,20
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15.11.30 144A (i)	USD	5.000	4.495	0,07
Molina Healthcare Inc, 3,875 %, 15.05.32 144A (i)	USD	20.000	17.475	0,26
Molina Healthcare Inc, 4,375 %, 15.06.28 144A (i)	USD	15.000	14.187	0,21
RP Escrow Issuer LLC, 5,250 %, 15.12.25 144A (i)	USD	10.000	8.001	0,12

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Gesundheit – 4,16 % (31. Dezember 2022: 2,72 %) (Fortsetzung)				
Star Parent Inc, 9,000 %, 01.10.30 144A (i)	USD	45.000	47.423	0,70
US Acute Care Solutions LLC, 6,375 %, 01.03.26 144A (i)	USD	10.000	8.356	0,12
			283.088	4,16
Möbel & Innenausstattung - 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,14 %)				
Tempur Sealy International Inc, 3,875 %, 15.10.31 144A (i)	USD	10.000	8.454	0,12
			8.454	0,12
Haushaltswaren - 0,36 % (31. Dezember 2022: 0,33 %)				
Newell Brands Inc, 5,200 %, 01.04.26	USD	25.000	24.655	0,36
			24.655	0,36
Versicherung - 2,18 % (31. Dezember 2022: 0,90 %)				
Acrisure LLC/Acrisure Finance Inc, 4,250 %, 15.02.29 144A (i)	USD	35.000	31.603	0,46
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer, 6,750 %, 15.10.27 144A (i)	USD	10.000	9.965	0,15
AmWINS Group Inc, 4,875 %, 30.06.29 144A (i)	USD	20.000	18.265	0,27
AssuredPartners Inc, 5,625 %, 15.01.29 144A (i)	USD	10.000	9.335	0,14
BroadStreet Partners Inc, 5,875 %, 15.04.29 144A (i)	USD	10.000	9.334	0,14
HUB International Ltd, 7,250 %, 15.06.30 144A (i)	USD	20.000	21.125	0,31
Liberty Mutual Group Inc, 4,300 %, 01.02.61 144A (i)	USD	35.000	23.126	0,34
USI Inc, 7,500 %, 15.01.32 144A (i)	USD	25.000	25.595	0,37
			148.348	2,18
Internet - 2,70 % (31. Dezember 2022: 3,81 %)				
ANGI Group LLC, 3,875 %, 15.08.28 144A (i)	USD	10.000	8.445	0,12
Arches Buyer Inc, 4,250 %, 01.06.28 144A (i)	USD	15.000	13.584	0,20
Arches Buyer Inc, 6,125 %, 01.12.28 144A (i)	USD	5.000	4.325	0,06
Newfold Digital Holdings Group Inc, 11,750 %, 15.10.28 144A (i)	USD	20.000	21.515	0,32
Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15.08.29 144A (i)	USD	130.000	124.016	1,82
Ziff Davis Inc, 4,625 %, 15.10.30 144A (i)	USD	13.000	11.927	0,18
			183.812	2,70
Investmentgesellschaften - 1,51 % (31. Dezember 2022: 1,35 %)				
Blackstone Secured Lending Fund, 2,750 %, 16.09.26	USD	5.000	4.574	0,07
Blackstone Secured Lending Fund, 3,625 %, 15.01.26	USD	15.000	14.308	0,21
Blue Owl Capital Corp, 3,400 %, 15.07.26	USD	20.000	18.594	0,27
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 4,375 %, 01.02.29	USD	30.000	25.052	0,37
Icahn Enterprises LP/Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15.05.27	USD	45.000	40.420	0,59
			102.948	1,51
Eisen/Stahl - 1,16 % (31. Dezember 2022: 0,82 %)				
ATI Inc, 4,875 %, 01.10.29	USD	10.000	9.320	0,14
ATI Inc, 7,250 %, 15.08.30	USD	15.000	15.606	0,23
Commercial Metals Co, 4,125 %, 15.01.30	USD	15.000	13.744	0,20
Mineral Resources Ltd, 8,000 %, 01.11.27 144A (i) (ii)	USD	10.000	10.205	0,15

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Eisen/Stahl – 1,16 % (31. Dezember 2022: 0,82 %) (Fortsetzung)				
Mineral Resources Ltd, 8,125 %, 01.05.27 144A (i) (ii)	USD	15.000	15.238	0,22
Mineral Resources Ltd, 9,250 %, 01.10.28 144A (i) (ii)	USD	10.000	10.638	0,16
United States Steel Corp, 6,875 %, 01.03.29	USD	4.000	4.092	0,06
			78.843	1,16
Freizeit - 4,65 % (31. Dezember 2022: 2,85 %)				
Carnival Corp, 5,750 %, 01.03.27 144A (i) (ii)	USD	55.000	53.649	0,79
Carnival Corp, 6,000 %, 01.05.29 144A (i) (ii)	USD	35.000	33.677	0,49
NCL Corp Ltd, 5,875 %, 15.03.26 144A (i) (ii)	USD	70.000	68.401	1,01
NCL Corp Ltd, 8,125 %, 15.01.29 144A (i) (ii)	USD	15.000	15.669	0,23
NCL Finance Ltd, 6,125 %, 15.03.28 144A (i) (ii)	USD	5.000	4.786	0,07
Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, 15.03.28 (ii)	USD	15.000	13.828	0,20
Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, 01.07.26 144A (i) (ii)	USD	40.000	38.635	0,57
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,500 %, 01.04.28 144A (i) (ii)	USD	40.000	39.491	0,58
Viking Cruises Ltd, 5,875 %, 15.09.27 144A (i) (ii)	USD	10.000	9.650	0,14
Viking Cruises Ltd, 7,000 %, 15.02.29 144A (i) (ii)	USD	5.000	4.957	0,07
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 5,625 %, 15.02.29 144A (i) (ii)	USD	25.000	24.375	0,36
VOC Escrow Ltd, 5,000 %, 15.02.28 144A (i) (ii)	USD	10.000	9.578	0,14
			316.696	4,65
Hotels - 3,04 % (31. Dezember 2022: 3,19 %)				
Boyd Gaming Corp, 4,750 %, 15.06.31 144A (i)	USD	25.000	22.945	0,34
Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,625 %, 15.02.32 144A (i)	USD	40.000	34.908	0,51
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 4,875 %, 01.07.31 144A (i)	USD	35.000	30.982	0,46
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc, 5,000 %, 01.06.29 144A (i)	USD	25.000	23.064	0,34
Marriott Ownership Resorts Inc, 4,500 %, 15.06.29 144A (i)	USD	75.000	66.091	0,97
Travel + Leisure Co, 4,625 %, 01.03.30 144A (i)	USD	10.000	8.943	0,13
Travel + Leisure Co, 6,000 %, 01.04.27	USD	20.000	19.889	0,29
			206.822	3,04
Maschinen – Diversifiziert - 0,46 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)				
GrafTech Finance Inc, 4,625 %, 15.12.28 144A (i)	USD	30.000	19.887	0,29
GrafTech Global Enterprises Inc, 9,875 %, 15.12.28 144A (i)	USD	15.000	11.563	0,17
			31.450	0,46
Medien - 11,51 % (31. Dezember 2022: 7,82 %)				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 01.02.31 144A (i)	USD	50.000	43.682	0,64
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15.01.34 144A (i)	USD	160.000	130.020	1,91
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 15.08.30 144A (i)	USD	65.000	58.597	0,86
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 01.05.32	USD	5.000	4.282	0,06

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Medien – 11,51 % (31. Dezember 2022: 7,82 %) (Fortsetzung)				
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, 01.06.33 144A (i)	USD	20.000	16.923	0,25
CSC Holdings LLC, 3,375 %, 2/15/31 144A (i)	USD	200.000	145.915	2,15
CSC Holdings LLC, 4,625 %, 01.12.30 144A (i)	USD	225.000	135.477	1,99
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co, 5,375 %, 15.08.26 144A (i) (v)	USD	30.000	1.500	0,02
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co, 6,625 %, 15.08.27 144A (i) (v)	USD	15.000	750	0,01
Directv Financing LLC/Directv Financing Co-Obligor Inc, 5,875 %, 15.08.27 144A (i)	USD	60.000	56.375	0,83
DISH DBS Corp, 5,125 %, 01.06.29	USD	50.000	25.770	0,38
DISH DBS Corp, 5,750 %, 01.12.28 144A (i)	USD	15.000	11.964	0,18
DISH DBS Corp, 7,375 %, 01.07.28	USD	40.000	23.911	0,35
DISH DBS Corp, 7,750 %, 01.07.26	USD	40.000	27.860	0,41
DISH Network Corp, 11,750 %, 15.11.27 144A (i)	USD	5.000	5.219	0,08
iHeartCommunications Inc, 4,750 %, 15.01.28 144A (i)	USD	55.000	42.312	0,62
iHeartCommunications Inc, 6,375 %, 01.05.26	USD	10.000	8.526	0,13
Radiate Holdco LLC/Radiate Finance Inc, 6,500 %, 15.09.28 144A (i)	USD	20.000	9.800	0,14
Sirius XM Radio Inc, 3,875 %, 01.09.31 144A (i)	USD	40.000	34.219	0,50
			783.102	11,51
Bergbau - 0,55 % (31. Dezember 2022: 2,66 %)				
Novelis Corp, 4,750 %, 30.01.30 144A (i)	USD	40.000	37.618	0,55
			37.618	0,55
Erdöl & -gas - 9,38 % (31. Dezember 2022: 8,46 %)				
Antero Resources Corp, 5,375 %, 01.03.30 144A (i)	USD	15.000	14.377	0,21
Apache Corp, 4,750 %, 15.04.43	USD	10.000	7.870	0,12
Ascent Resources Utica Holdings LLC/ARU Finance Corp, 7,000 %, 01.11.26 144A (i)	USD	25.000	25.158	0,37
Baytex Energy Corp, 8,500 %, 30.04.30 144A (i)	USD	10.000	10.349	0,15
Baytex Energy Corp, 8,750 %, 01.04.27 144A (i)	USD	20.000	20.663	0,30
Chesapeake Energy Corp, 5,500 %, 01.02.26 144A (i)	USD	30.000	29.740	0,44
Chesapeake Energy Corp, 6,750 %, 15.04.29 144A (i)	USD	5.000	5.046	0,07
Civitas Resources Inc, 8,375 %, 01.07.28 144A (i)	USD	25.000	26.099	0,38
Civitas Resources Inc, 8,625 %, 01.11.30 144A (i)	USD	5.000	5.304	0,08
Crescent Energy Finance LLC, 7,250 %, 01.05.26 144A (i)	USD	10.000	10.062	0,15
Crescent Energy Finance LLC, 9,250 %, 15.02.28 144A (i)	USD	10.000	10.376	0,15
CVR Energy Inc, 5,250 %, 15.02.25 144A (i)	USD	25.000	24.957	0,37
CVR Energy Inc, 8,500 %, 15.01.29 144A (i)	USD	20.000	19.900	0,29
Diamond Foreign Asset Co/Diamond Finance LLC, 8,500 %, 01.10.30 144A (i) (ii)	USD	10.000	10.226	0,15
Energean Israel Finance Ltd, 4,875 %, 30.03.26 144A (i) (ii)	USD	20.000	18.400	0,27
Gulfport Energy Corp, 8,000 %, 17.05.26 144A (i)	USD	5.000	5.054	0,07
HF Sinclair Corp, 5,000 %, 01.02.28 144A (i)	USD	10.000	9.698	0,14

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Erdöl & -gas – 9,38 % (31. Dezember 2022: 8,46 %) (Fortsetzung)				
Leviathan Bond Ltd, 6,750 %, 30.06.30 144A (i) (ii)	USD	25.000	22.754	0,33
Matador Resources Co, 5,875 %, 15.09.26	USD	10.000	9.917	0,15
Matador Resources Co, 6,875 %, 15.04.28 144A (i)	USD	15.000	15.215	0,22
Mesquite Energy Inc, 6,125 %, 15.01.24	USD	420.000	28.350	0,42
Murphy Oil Corp, 5,875 %, 01.12.42	USD	15.000	13.253	0,19
Nabors Industries Inc, 9,125 %, 31.01.30 144A (i)	USD	10.000	10.041	0,15
Northern Oil & Gas Inc, 8,125 %, 01.03.28 144A (i)	USD	30.000	30.375	0,45
Northern Oil & Gas Inc, 8,750 %, 15.06.31 144A (i)	USD	5.000	5.208	0,08
Parkland Corp, 4,500 %, 01.10.29 144A (i)	USD	20.000	18.329	0,27
Parkland Corp, 4,625 %, 01.05.30 144A (i)	USD	25.000	23.000	0,34
PBF Holding Co LLC/PBF Finance Corp, 7,875 %, 15.09.30 144A (i)	USD	5.000	5.092	0,08
Permian Resources Operating LLC, 5,375 %, 15.01.26 144A (i)	USD	5.000	4.933	0,07
Permian Resources Operating LLC, 5,875 %, 01.07.29 144A (i)	USD	5.000	4.875	0,07
Permian Resources Operating LLC, 6,875 %, 01.04.27 144A (i)	USD	30.000	29.979	0,44
Permian Resources Operating LLC, 7,000 %, 15.01.32 144A (i)	USD	10.000	10.317	0,15
Range Resources Corp, 8,250 %, 15.01.29	USD	10.000	10.350	0,15
Sitio Royalties Operating Partnership LP/Sitio Finance Corp, 7,875 %, 01.11.28 144A (i)	USD	35.000	36.268	0,53
SM Energy Co, 5,625 %, 01.06.25	USD	10.000	9.882	0,15
SM Energy Co, 6,750 %, 15.09.26	USD	10.000	9.974	0,15
Southwestern Energy Co, 5,375 %, 01.02.29	USD	5.000	4.879	0,07
Strathcona Resources Ltd, 6,875 %, 01.08.26 144A (i)	USD	5.000	4.773	0,07
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp, 4,500 %, 15.05.29	USD	5.000	4.645	0,07
Transocean Aquila Ltd, 8,000 %, 30.09.28 144A (i) (ii)	USD	5.000	5.075	0,07
Transocean Inc, 7,500 %, 15.01.26 144A (i) (ii)	USD	15.000	14.737	0,22
Transocean Poseidon Ltd, 6,875 %, 01.02.27 144A (i) (ii)	USD	37.500	37.314	0,55
Transocean Titan Financing Ltd, 8,375 %, 01.02.28 144A (i) (ii)	USD	15.000	15.562	0,23
			638.376	9,38
Öl- & Gasdienstleistungen - 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,60 %)				
Oceaneering International Inc, 6,000 %, 01.02.28 144A (i)	USD	5.000	4.872	0,07
Weatherford International Ltd, 8,625 %, 30.04.30 144A (i) (ii)	USD	15.000	15.661	0,23
			20.533	0,30
Verpackung - 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,10 %)				
Graham Packaging Co Inc, 7,125 %, 15.08.28 144A (i)	USD	5.000	4.500	0,06
Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 6,125 %, 01.02.28 144A (i)	USD	10.000	10.086	0,15
			14.586	0,21
Pharmawerte - 3,79 % (31. Dezember 2022: 3,76 %)				
AdaptHealth LLC, 4,625 %, 01.08.29 144A (i)	USD	5.000	3.859	0,06
AdaptHealth LLC, 5,125 %, 01.03.30 144A (i)	USD	25.000	19.502	0,29
Bausch Health Cos Inc, 4,875 %, 01.06.28 144A (i)	USD	70.000	42.157	0,62
Bausch Health Cos Inc, 5,250 %, 30.01.30 144A (i)	USD	40.000	18.439	0,27

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Pharmawerte – 3,79 % (31. Dezember 2022: 3,76 %) (Fortsetzung)				
Bausch Health Cos Inc, 6,125 %, 01.02.27 144A (i)	USD	15.000	10.125	0,15
HLF Financing Sarl LLC/Herbalife International Inc, 4,875%, 01.06.29 144A (i)	USD	5.000	3.926	0,06
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01.10.26 (ii)	USD	70.000	64.813	0,95
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, 01.10.46 (ii)	USD	140.000	94.758	1,39
			257.579	3,79
Pipelines - 4,67 % (31. Dezember 2022: 4,49 %)				
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 5,375 %, 15.06.29 144A (i)	USD	10.000	9.614	0,14
Antero Midstream Partners LP/Antero Midstream Finance Corp, 7,875 %, 15.05.26 144A (i)	USD	5.000	5.121	0,08
Buckeye Partners LP, 5,600 %, 15.10.44	USD	10.000	7.694	0,11
Buckeye Partners LP, 5,850 %, 15.11.43	USD	5.000	4.050	0,06
Energy Transfer LP, 6,000 %, 01.02.29 144A (i)	USD	15.000	15.135	0,22
Energy Transfer LP, 9,669 % (iii) (iv)	USD	40.000	38.413	0,57
EnLink Midstream LLC, 6,500 %, 01.09.30 144A (i)	USD	10.000	10.206	0,15
EnLink Midstream Partners LP, 5,050 %, 01.04.45	USD	5.000	4.138	0,06
EnLink Midstream Partners LP, 5,450 %, 01.06.47	USD	15.000	13.088	0,19
Enterprise Products Operating LLC, 5,250 %, 16.08.77 (iii)	USD	5.000	4.780	0,07
EQM Midstream Partners LP, 5,500 %, 15.07.28	USD	10.000	9.908	0,15
EQM Midstream Partners LP, 6,500 %, 01.07.27 144A (i)	USD	35.000	35.638	0,52
EQM Midstream Partners LP, 7,500 %, 01.06.27 144A (i)	USD	15.000	15.456	0,23
Hess Midstream Operations LP, 4,250 %, 15.02.30 144A (i)	USD	25.000	23.000	0,34
Hess Midstream Operations LP, 5,125 %, 15.06.28 144A (i)	USD	15.000	14.472	0,21
Hess Midstream Operations LP, 5,625 %, 15.02.26 144A (i)	USD	5.000	4.963	0,07
Kinetik Holdings LP, 5,875 %, 15.06.30 144A (i)	USD	15.000	14.716	0,22
Kinetik Holdings LP, 6,625 %, 15.12.28 144A (i)	USD	20.000	20.376	0,30
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 3,875 %, 01.11.33 144A (i)	USD	35.000	29.661	0,44
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 4,125 %, 15.08.31 144A (i)	USD	25.000	22.025	0,32
Venture Global LNG Inc, 8,375 %, 01.06.31 144A (i)	USD	15.000	14.992	0,22
			317.446	4,67
Immobilien - 0,17 % (31. Dezember 2022: 0,17 %)				
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp, 5,750 %, 15.01.29 144A (i)	USD	15.000	11.657	0,17
			11.657	0,17
Real Estate Investment Trusts - 2,08 % (31. Dezember 2022: 2,36 %)				
Iron Mountain Inc, 4,500 %, 15.02.31 144A (i)	USD	10.000	9.055	0,13
Iron Mountain Inc, 4,875 %, 15.09.29 144A (i)	USD	40.000	37.883	0,56
Iron Mountain Inc, 5,250 %, 15.07.30 144A (i)	USD	15.000	14.279	0,21
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 3,500 %, 15.03.31	USD	20.000	12.504	0,19
Service Properties Trust, 3,950 %, 15.01.28	USD	5.000	4.096	0,06

Vermögensaufstellung			**Zum 31. Dezember 2023**	
		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Real Estate Investment Trusts – 2,08 % (31. Dezember 2022: 2,36 %) (Fortsetzung)				
Service Properties Trust, 7,500 %, 15.09.25	USD	25.000	25.278	0,37
Service Properties Trust, 8,625 %, 15.11.31 144A (i)	USD	20.000	20.949	0,31
Uniti Group LP/Uniti Group Finance Inc/CSL Capital LLC, 4,750 %, 15.04.28 144A (i)	USD	20.000	17.238	0,25
			141.282	2,08
Einzelhandel - 4,95 % (31. Dezember 2022: 3,52 %)				
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 3,500 %, 15.02.29 144A (i)	USD	5.000	4.610	0,07
1011778 BC ULC/New Red Finance Inc, 3,875 %, 15.01.28 144A (i)	USD	65.000	61.407	0,90
Asbury Automotive Group Inc, 4,500 %, 01.03.28	USD	10.000	9.498	0,14
Asbury Automotive Group Inc, 4,625 %, 15.11.29 144A (i)	USD	35.000	32.396	0,48
Bath & Body Works Inc, 5,250 %, 01.02.28	USD	5.000	4.945	0,07
Bath & Body Works Inc, 6,625 %, 01.10.30 144A (i)	USD	5.000	5.110	0,08
Bath & Body Works Inc, 6,875 %, 01.11.35	USD	5.000	5.063	0,07
Beacon Roofing Supply Inc, 6,500 %, 01.08.30 144A (i)	USD	20.000	20.449	0,30
Bloomin' Brands Inc/OSI Restaurant Partners LLC, 5,125 %, 15.04.29 144A (i)	USD	10.000	9.225	0,14
Ferrellgas LP/Ferrellgas Finance Corp, 5,375 %, 01.04.26 144A (i)	USD	15.000	14.680	0,22
Foundation Building Materials Inc, 6,000 %, 01.03.29 144A (i)	USD	30.000	26.974	0,40
Ken Garff Automotive LLC, 4,875 %, 15.09.28 144A (i)	USD	5.000	4.732	0,07
LBM Acquisition LLC, 6,250 %, 15.01.29 144A (i)	USD	10.000	8.930	0,13
Lithia Motors Inc, 4,375 %, 15.01.31 144A (i)	USD	10.000	9.090	0,13
NMG Holding Co Inc/Neiman Marcus Group LLC, 7,125 %, 01.04.26 144A (i)	USD	10.000	9.609	0,14
Papa John's International Inc, 3,875 %, 15.09.29 144A (i)	USD	25.000	22.114	0,33
Patrick Industries Inc, 4,750 %, 01.05.29 144A (i)	USD	10.000	9.106	0,13
Sonic Automotive Inc, 4,625 %, 15.11.29 144A (i)	USD	25.000	22.750	0,33
Sonic Automotive Inc, 4,875 %, 15.11.31 144A (i)	USD	10.000	8.914	0,13
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp, 6,375 %, 30.09.26 144A (i)	USD	20.000	19.615	0,29
Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,000 %, 01.06.31 144A (i)	USD	10.000	9.066	0,13
Yum! Brands Inc, 3,625 %, 15.03.31	USD	10.000	9.018	0,13
Yum! Brands Inc, 4,625 %, 31.01.32	USD	10.000	9.351	0,14
			336.652	4,95
Halbleiter - 0,42 % (31. Dezember 2022: 1,04 %)				
Entegris Escrow Corp, 4,750 %, 15.04.29 144A (i)	USD	30.000	28.902	0,42
			28.902	0,42
Software - 1,15 % (31. Dezember 2022: 1,57 %)				
Cloud Software Group Inc, 6,500 %, 31.03.29 144A (i)	USD	25.000	23.811	0,35
Dun & Bradstreet Corp, 5,000 %, 15.12.29 144A (i)	USD	5.000	4.664	0,07
Elastic NV, 4,125 %, 15.07.29 144A (i) (ii)	USD	20.000	18.365	0,27

Vermögensaufstellung				**Zum 31. Dezember 2023**
		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Software – 1,15 % (31. Dezember 2022: 1,57 %) (Fortsetzung)				
Open Text Corp, 6,900 %, 01.12.27 144A (i)	USD	20.000	20.793	0,30
Open Text Holdings Inc, 4,125 %, 15.02.30 144A (i)	USD	5.000	4.525	0,07
Playtika Holding Corp, 4,250 %, 15.03.29 144A (i)	USD	5.000	4.363	0,06
Rackspace Technology Global Inc, 5,375 %, 01.12.28 144A (i)	USD	5.000	1.795	0,03
			78.316	1,15
Staatsanleihen - 1,76 % (31. Dezember 2022: 6,27 %)				
United States Treasury Bill, 5,329 %, 09.04.24	USD	25.000	24.640	0,36
United States Treasury Bill, 5,364 %, 04.01.24	USD	95.000	94.958	1,40
			119.598	1,76
Telekommunikation - 3,00 % (31. Dezember 2022: 6,54 %)				
CommScope Inc, 4,750 %, 01.09.29 144A (i)	USD	10.000	6.714	0,10
CommScope Inc, 6,000 %, 01.03.26 144A (i)	USD	10.000	8.915	0,13
CommScope Technologies LLC, 5,000 %, 15.03.27 144A (i)	USD	65.000	27.056	0,40
Frontier Communications Holdings LLC, 5,000 %, 01.05.28 144A (i)	USD	25.000	23.104	0,34
Frontier Communications Holdings LLC, 5,875 %, 15.10.27 144A (i)	USD	30.000	28.983	0,43
Frontier Communications Holdings LLC, 8,750 %, 15.05.30 144A (i)	USD	5.000	5.144	0,07
GoTo Group Inc, 5,500 %, 01.09.27 144A (i)	USD	25.000	12.092	0,18
Level 3 Financing Inc, 3,625 %, 15.01.29 144A (i)	USD	10.000	4.200	0,06
Level 3 Financing Inc, 4,250 %, 01.07.28 144A (i)	USD	5.000	2.475	0,04
Lumen Technologies Inc, 4,000 %, 15.02.27 144A (i)	USD	10.000	6.454	0,09
Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, 30.09.34 (ii)	USD	65.000	61.729	0,91
Telesat Canada/Telesat LLC, 5,625 %, 06.12.26 144A (i)	USD	15.000	9.199	0,13
ViaSat Inc, 6,500 %, 15.07.28 144A (i)	USD	10.000	8.213	0,12
			204.278	3,00
Transportdienstleister - 0,84 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Rand Parent LLC, 8,500 %, 15.02.30 144A (i)	USD	60.000	57.387	0,84
			57.387	0,84
Wasser – 0,15 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)				
Solaris Midstream Holdings LLC, 7,625 %, 01.04.26 144A (i)	USD	10.000	10.135	0,15
			10.135	0,15
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**6.098.035**	**89,61**
WANDELANLEIHEN – 5,19 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 5,62 %)				
Fluggesellschaften – 0,52 % (31. Dezember 2022: 0,56 %)				
Southwest Airlines Co, 1,250 %, 01.05.25	USD	35.000	35.368	0,52
			35.368	0,52
Biotechnologie - 1,03 % (31. Dezember 2022: 0,95 %)				
BioMarin Pharmaceutical Inc, 1,250 %, 15.05.27	USD	50.000	51.345	0,75

Vermögensaufstellung				**Zum 31. Dezember 2023**
		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
WANDELANLEIHEN (Fortsetzung)				
Biotechnologie – 1,03 % (31. Dezember 2022: 0,95 %) (Fortsetzung)				
Livongo Health Inc, 0,875 %, 01.06.25	USD	20.000	18.698	0,28
			70.043	1,03
Gesundheit - 0,93 % (31. Dezember 2022: 0,78 %)				
Envista Holdings Corp, 1,750 %, 15.08.28 144A (i)	USD	20.000	18.200	0,27
Teladoc Health Inc, 1,250 %, 01.06.27	USD	55.000	45.205	0,66
			63.405	0,93
Medien - 2,35 % (31. Dezember 2022: 2,51 %)				
DISH Network Corp, 3,375 %, 15.08.26	USD	295.000	156.350	2,30
DISH Network Corp, Zero Coupon Bond, 15.12.25	USD	5.000	3.100	0,05
			159.450	2,35
Erdöl & -gas - 0,26 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Northern Oil & Gas Inc, 3,625 %, 15.04.29	USD	15.000	17.685	0,26
			17.685	0,26
Halbleiter - 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Wolfspeed Inc, 1,875 %, 01.12.29	USD	10.000	6.815	0,10
			6.815	0,10
WANDELANLEIHEN, GESAMT			**352.766**	**5,19**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**6.450.801**	**94,79**
		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN – 0,66 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 0,96 %)				
Real Estate Investment Trusts - 0,66 % (31. Dezember 2022: 0,54 %)				
Highwoods Properties Inc, 8,625 % (iv)	USD	45	44.539	0,66
			44.539	0,66
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN, GESAMT			**44.539**	**0,66**
NICHT WANDELBARE VORZUGSAKTIEN – 0,30 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 0,22 %)				
Software - 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)				
Clarivate PLC, 5,250 %, 01.06.24	USD	546	20.704	0,30
			20.704	0,30
WANDELBARE VORZUGSAKTIEN, GESAMT			**20.704**	**0,30**

Vermögensaufstellung			**Zum 31. Dezember 2023**
	Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN – 0,03 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 0,02 %)			
Erdöl & -gas - 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)			
Battalion Oil Corp USD	207	1.989	0,03
		1.989	0,03
STAMMAKTIEN, GESAMT		**1.989**	**0,03**
ANLAGEFONDS – 2,25 % des NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 2,83 %)			
Gewerbliche Dienste – 2,25 % (31. Dezember 2022: 2,83 %)			
Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund (ii) USD	22	153.191	2,25
		153.191	2,25
INVESTMENTFONDS, GESAMT		**153.191**	**2,25**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: USD 7.681.523)		**6.671.224**	**98,03**

FINANZDERIVATE – 0,63 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,63 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Fälligkeits-datum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
1. Februar 2024	USD 1.912.513	EUR 1.733.910	Brown Brothers Harriman	(2.850)	(0,04 %)
1. Februar 2024	USD 3.288	EUR 2.981	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)
1. Februar 2024	EUR 2.981	USD 3.222	Brown Brothers Harriman	70	0,00 %
1. Februar 2024	EUR 1.733.910	USD 1.874.543	Brown Brothers Harriman	40.820	0,60 %
1/31/24	USD 1.874.383	EUR 1.733.910	Brown Brothers Harriman	(43.278)	(0,64 %)
1/31/24	USD 3.222	EUR 2.981	Brown Brothers Harriman	(75)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 80	USD 88	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	EUR 2.981	USD 3.288	Brown Brothers Harriman	9	0,00 %
1/31/24	EUR 2.900	USD 3.134	Brown Brothers Harriman	74	0,00 %
1/31/24	EUR 35.086	USD 38.628	Brown Brothers Harriman	176	0,00 %

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,63 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
1/31/24	EUR 1.733.910	USD 1.912.513	Brown Brothers Harriman	5.149	0,08 %
1/31/24	EUR 1.698.823	USD 1.835.755	Brown Brothers Harriman	43.102	0,63 %
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				89.401	1,31 %
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten				(46.208)	(0,68 %)
Nicht realisierter Nettogewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				**43.193**	**0,63 %**

	Zeitwert USD	**% des Nettovermögens**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**6.760.625**	**99,35**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(46.208)**	**(0,68)**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**6.714.417**	**98,67**
Bankguthaben	92.201	1,35
Sonstige Vermögenswerte	107.358	1,58
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(109.009)	(1,60)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**6.804.967**	**100,00**

(i) Wertpapiere, die nach Rule 144A (i) des U.S. Securities Act aus dem Jahr 1933 nicht registriert werden müssen. Sie können im Rahmen von registrierungsfreien Transaktionen veräußert werden, in der Regel an entsprechend qualifizierte institutionelle Anleger.
(ii) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(iii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(iv) Ewige Anleihen.
(v) Wertpapier mit Zahlungsverzug.

Abkürzungen:

EUR: Euro
USD: US-Dollar

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögens**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	10,17
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	84,59
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an offiziellen Börsen notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden.	1,73
Finanzderivate	0,62
Umlaufvermögen	2,89
	100,00

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 96,41 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,42 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 96,41 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,42 %)				
Australien - 1,86 % (31. Dezember 2022: 2,51 %)				
National Australia Bank Ltd, 5,000 %, 11.03.24 (i)	AUD	250.000	170.661	1,07
New South Wales Treasury Corp, 2,000 %, 08.03.33 (i)	AUD	230.000	127.373	0,79
			298.034	1,86
Brasilien - 0,93 % (31. Dezember 2022: 1,33 %)				
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01.01.27 (i)	BRL	723.000	149.637	0,93
			149.637	0,93
Kanada - 2,84 % (31. Dezember 2022: 1,76 %)				
Canada Housing Trust No 1, 1,550 %, 15.12.26 144A (ii)	CAD	75.000	53.522	0,34
Canadian Government, 1,500 %, 01.06.26	CAD	240.000	173.430	1,08
Province of British Columbia Canada, 4,300 %, 18.06.42	CAD	45.000	35.300	0,22
Province of Ontario Canada, 1,900 %, 02.12.51 *	CAD	200.000	100.033	0,63
Province of Quebec Canada, Zero Coupon Bond, 29.10.30 EMTN	EUR	100.000	91.938	0,57
			454.223	2,84
China - 5,95 % (31. Dezember 2022: 6,60 %)				
China Development Bank, 3,020 %, 03.06.33 (i)	CNY	3.020.000	433.700	2,71
China Development Bank, 3,300 %, 03.03.26 (i)	CNY	2.790.000	401.343	2,50
China Government Bond, 3,720 %, 12.04.51 (i)	CNY	730.000	118.655	0,74
			953.698	5,95
Dänemark – 1,73 % (31. Dezember 2022: 0,00%)				
Danske Bank A/S, 4,750 %, 21.06.30 EMTN (i) (iii)	EUR	100.000	116.403	0,73
Denmark Government Bond, 2,250 %, 15.11.33 (i)	DKK	1.085.000	160.937	1,00
			277.340	1,73
Frankreich – 3,15 % (31. Dezember 2022: 1,75%)				
Electricite de France SA, 2,000 %, 09.12.49 EMTN (i)	EUR	100.000	73.233	0,46
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, 25.05.28 (i)	EUR	115.000	119.289	0,74
French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, 25.05.45 (i)	EUR	55.000	63.374	0,40
French Republic Government Bond OAT, Zero Coupon Bond, 25.05.32 (i)	EUR	275.000	248.625	1,55
			504.521	3,15
Deutschland – 6,75 % (31. Dezember 2022: 8,91%)				
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 15.08.28 (i)	EUR	85.000	87.126	0,54
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15.02.26 (i)	EUR	230.000	244.726	1,53
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 15.02.33 (i)	EUR	140.000	158.677	0,99
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04.01.37 (i)	EUR	165.000	219.307	1,37
German Treasury Bill, 3,560 %, 17.07.24 (i)	EUR	285.000	308.864	1,93
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,875 %, 28.12.29 EMTN (i)	EUR	55.000	62.235	0,39
			1.080.935	6,75
Indonesien – 1,37 % (31. Dezember 2022: 0,44%)				
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15.02.33 (i)*	IDR	3.276.000.000	220.141	1,37
			220.141	1,37
Irland - 2,64 % (31. Dezember 2022: 0,98 %)				
AIB Group PLC, 5,750 %, 16.02.29 (i) (iii)	EUR	155.000	184.010	1,15
Republic of Ireland, 1,000 %, 15.05.26 (i)	EUR	65.000	69.631	0,43
Republic of Ireland, Zero Coupon Bond, 18.10.31 (i)	EUR	50.000	46.209	0,29

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Irland - 2,64 % (31. Dezember 2022: 0,98 %) (Fortsetzung)				
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co 5,125 % 23.11.52 EMTN (i) (iii)	GBP	100.000	122.638	0,77
			422.488	2,64
Israel - 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,13 %)				
Israel Government Bond - Fixed, 1,000 %, 31.03.30 (i)	ILS	65.000	15.283	0,10
			15.283	0,10
Italien - 1,01 % (31. Dezember 2022: 2,48 %)				
Intesa Sanpaolo SpA, 5,148 %, 10.06.30 EMTN (i)	GBP	140.000	161.367	1,01
			161.367	1,01
Japan - 6,18 % (31. Dezember 2022: 6,39 %)				
Development Bank of Japan Inc, 0,875 %, 10.10.25 EMTN (i)	EUR	150.000	159.580	1,00
Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20.12.25 (i)	JPY	76.150.000	540.969	3,38
Japan Government Thirty Year Bond, 0,300 %, 20.06.46 (i)	JPY	52.750.000	289.212	1,80
			989.761	6,18
Luxemburg - 0,53 % (31. Dezember 2022: 1,21 %)				
Logicor Financing Sarl, 0,875 %, 14.01.31 EMTN (i)	EUR	100.000	84.917	0,53
			84.917	0,53
Malaysia - 0,34 % (31. Dezember 2022: 0,34 %)				
Malaysia Government Bond, 3,906 %, 15.07.26 (i)*	MYR	250.000	54.964	0,34
			54.964	0,34
Mexiko - 2,13 % (31. Dezember 2022: 1,28 %)				
Mexican Bonos, 8,500%, 31.05.29 (i)	MXN	2.972.200	172.203	1,07
Mexico Government International Bond, 3,500 %, 12.02.34 (i)	USD	200.000	169.205	1,06
			341.408	2,13
Niederlande - 1,69 % (31. Dezember 2022: 1,53 %)				
Digital Dutch Finco BV, 1,000 %, 15.01.32 (i)	EUR	100.000	87.854	0,55
EDP Finance BV, 0,375 %, 16.09.26 EMTN (i)	EUR	100.000	102.839	0,64
Enel Finance International NV, 5,750 %, 14.09.40 EMTN (i)	GBP	60.000	79.747	0,50
			270.440	1,69
Neuseeland - 1,15 % (31. Dezember 2022: 1,27 %)				
New Zealand Government Bond, 4,500 %, 15.04.27 (i)	NZD	290.000	184.871	1,15
			184.871	1,15
Singapur - 1,09 % (31. Dezember 2022: 0,59 %)				
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, 19.05.33 (i)	USD	55.000	55.124	0,34
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, 19.05.53 (i)	USD	45.000	45.940	0,29
Singapore Government Bond, 2,125 %, 01.06.26 (i)	SGD	100.000	74.126	0,46
			175.190	1,09
Südafrika - 1,96 % (31. Dezember 2022: 1,75 %)				
Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28.02.31 (i)	ZAR	6.855.000	313.559	1,96
			313.559	1,96
Südkorea - 2,15 % (31. Dezember 2022: 1,26 %)				
Korea Treasury Bond, 4,250 %, 10.12.32 (i)	KRW	410.700.000	344.176	2,15
			344.176	2,15
Spanien - 2,21 % (31. Dezember 2022: 2,41 %)				
Autonomous Community of Madrid Spain, 4,300 %, 15.09.26 (i)	EUR	70.000	80.095	0,50
Spain Government Bond, 1,300 %, 31.10.26 144A (i) (ii)	EUR	125.000	133.379	0,83
Spain Government Bond, 4,200%, 31.01.37 144A (i) (ii)	EUR	115.000	140.417	0,88
			353.891	2,21

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Supranational - 2,03 % (31. Dezember 2022: 3,08 %)				
European Union, 1,000 %, 06.07.32 (i)	EUR	170.000	165.359	1,03
International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, 18.09.30 (i)	CAD	85.000	67.078	0,42
Nordic Investment Bank, 1,500 %, 13.03.25 EMTN (i)	NOK	970.000	92.449	0,58
			324.886	2,03
Schweden - 0,36 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)				
Kommuninvest I Sverige ab, 1,000%, 12.05.25 (i)	SEK	520.000	50.000	0,31
Sweden Government Bond, 2,500 %, 12.05.25 (i)	SEK	75.000	7.402	0,05
			57.402	0,36
Schweiz - 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,49 %)				
UBS Group AG, 0,650 %, 10.09.29 EMTN (i)	EUR	100.000	93.922	0,59
			93.922	0,59
Thailand - 0,29 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)				
Thailand Government Bond, 1,600 %, 17.12.29 (i)*	THB	1.700.000	47.218	0,29
			47.218	0,29
Vereinigtes Königreich - 2,44 % (31. Dezember 2022: 4,36 %)				
National Grid PLC, 4,275 %, 16.01.35 EMTN (i)	EUR	100.000	114.197	0,71
United Kingdom Treasury, 4,750 %, 07.12.30 (i)	GBP	200.000	276.063	1,73
			390.260	2,44
Vereinigte Staaten - 42,94 % (31. Dezember 2022: 40,70 %)				
Ally Financial Inc, 3,875 %, 21.05.24	USD	30.000	29.741	0,19
Amgen Inc, 5,250 %, 02.03.33	USD	85.000	87.145	0,54
Amgen Inc, 5,650 %, 02.03.53	USD	35.000	36.823	0,23
AT&T Inc, 2,250 %, 01.02.32	USD	180.000	148.849	0,93
Bank of America Corp, 5,288 %, 25.04.34 (iii)	USD	80.000	80.184	0,50
Broadcom Inc, 3,419 %, 15.04.33 144A (ii)	USD	25.000	21.958	0,14
Broadcom Inc, 3,469 %, 15.04.34 144A (ii)	USD	25.000	21.750	0,14
Centene Corp, 3,000 %, 15.10.30	USD	75.000	64.953	0,41
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,300 %, 01.02.32	USD	10.000	7.958	0,05
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 2,800 %, 01.04.31	USD	65.000	54.825	0,34
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, 01.04.51	USD	30.000	19.513	0,12
Citigroup Inc, 2,400 %, 31.10.25	JPY	11.000.000	80.089	0,50
Citigroup Inc, 4,400 %, 10.06.25	USD	35.000	34.547	0,22
Comcast Corp, 4,650 %, 15.02.33	USD	35.000	35.211	0,22
Continental Resources Inc, 2,875 %, 01.04.32 144A (ii)	USD	80.000	64.899	0,40
CVS Health Corp, 5,300 %, 01.06.33	USD	80.000	82.097	0,51
Energy Transfer LP, 5,300 %, 15.04.47	USD	30.000	27.505	0,17
EQT Corp, 3,625 %, 15.05.31 144A (ii)	USD	5.000	4.465	0,03
ERAC USA Finance LLC, 4,500 %, 15.02.45 144A (ii)	USD	50.000	45.296	0,28
Fannie Mae Pool, 2,500 %, 01.05.52	USD	46.251	39.364	0,25
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01.04.45	USD	27.314	24.909	0,16
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01.11.51	USD	469.328	415.340	2,59
Fannie Mae Pool, 4,000 %, 01.03.49	USD	259.679	249.863	1,56
Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01.02.47	USD	5.332	5.259	0,03
Fannie Mae Pool, 4,500 %, 01.03.47	USD	176.968	175.133	1,09
Fannie Mae Pool, 6,500 %, 01.05.53	USD	206.591	211.697	1,32
Fannie Mae-Aces, 2,932%, 25.09.27 (iii)	USD	71.316	67.887	0,42

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten – 42,94 % (31. Dezember 2022: 40,70 %) (Fortsetzung)				
Freddie Mac Gold Pool, 3,500 %, 01.12.46	USD	8.994	8.526	0,05
Freddie Mac Gold Pool, 4,500 %, 01.07.39	USD	21.523	21.519	0,13
Freddie Mac Pool, 2,000 %, 01.06.52	USD	153.443	125.387	0,78
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01.12.51	USD	702.690	598.054	3,73
Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01.10.48	USD	96.769	97.235	0,61
Freddie Mac Pool, 5,000 %, 01.11.48	USD	63.465	63.829	0,40
Freddie Mac Pool, 7,000 %, 01.12.53	USD	29.715	30.657	0,19
Goldman Sachs Group Inc, 1,000 %, 24.11.25 EMTN	CHF	65.000	76.286	0,48
HCA Inc, 2,375 %, 15.07.31	USD	120.000	98.876	0,62
HCA Inc, 5,500 %, 01.06.33	USD	40.000	40.628	0,25
Oracle Corp, 5,550 %, 06.02.53	USD	45.000	45.013	0,28
Ovintiv Inc, 6,250 %, 15.07.33	USD	40.000	41.351	0,26
Ovintiv Inc, 7,375 %, 01.11.31	USD	20.000	22.032	0,14
T-Mobile USA Inc, 3,400 %, 15.10.52	USD	25.000	18.209	0,11
Thermo Fisher Scientific Inc, 5,086 %, 10.08.33	USD	75.000	78.171	0,49
T-Mobile USA Inc, 2.550 %, 15.02.31	USD	15.000	12.920	0,08
T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15.07.33	USD	110.000	110.855	0,69
Towd Point Mortgage Trust, 2,750 %, 25.10.57 144A (ii) (iii)	USD	73.403	70.248	0,44
United Airlines, 3,650 %, 07.10.25	USD	145.833	141.960	0,89
United States Treasury Inflation Indexed Note, 0,625 %, 7/15/32	USD	174.723	159.596	1,00
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15.02.41	USD	505.000	363.067	2,27
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, 30.04.24	USD	400.000	396.344	2,47
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31.01.30	USD	650.000	635.705	3,97
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 31.05.28	USD	340.000	336.401	2,10
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15.02.53	USD	505.000	466.336	2,91
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, 31.10.27	USD	420.000	422.641	2,64
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 15.11.33	USD	60.000	62.991	0,39
UnitedHealth Group Inc, 4,500%, 4/15/33	USD	125.000	124.206	0,78
Verizon Communications Inc, 2,850 %, 03.09.41	USD	25.000	18.469	0,11
VMware LLC, 2,200 %, 15.08.31	USD	65.000	53.860	0,34
			6.878.632	42,94
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**15.443.164**	**96,41**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**15.443.164**	**96,41**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: USD 15.925.083)			**15.443.164**	**96,41**

FINANZDERIVATE – 0,04 % (31. Dezember 2022: (0,07 %))

Offene Devisenterminkontrakte – 0,01 % (31. Dezember 2022: (0,06 %))

Fälligkeits-datum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
3/4/24	USD 342.911	BRL 1.697.000	Bank of America	(4.306)	(0,03 %)
3/4/24	BRL 955.000	USD 191.806	Bank of America	3.594	0,02 %
3/19/24	USD 42.562	JPY 6.000.000	Bank of America	(510)	(0,00 %)
3/19/24	JPY 143.467.000	USD 1.002.915	Bank of America	26.971	0,17 %
3/20/24	USD 270.776	EUR 247.000	Bank of America	(2.929)	(0,02 %)
3/20/24	USD 152.839	KRW 199.700.000	Bank of America	(2.923)	(0,02 %)
3/20/24	EUR 36.000	USD 39.472	Bank of America	420	0,00 %
3/20/24	USD 46.336	SGD 62.000	Barclays Bank PLC	(835)	(0,01 %)
3/20/24	PLN 114.000	EUR 26.162	Barclays Bank PLC	(30)	(0,00 %)
3/20/24	USD 155.178	NZD 250.000	BNP Paribas SA	(3.139)	(0,02 %)
3/20/24	USD 151.272	IDR 2.370.506.000	BNP Paribas SA	(2.551)	(0,02 %)
3/20/24	USD 164.884	GBP 131.000	BNP Paribas SA	(2.179)	(0,01 %)
3/20/24	GBP 131.000	USD 166.429	BNP Paribas SA	634	0,00 %
3/20/24	CNH 1.096.000	USD 153.984	BNP Paribas SA	763	0,01 %
1/31/24	EUR 38.903	JPY 6.075.110	Brown Brothers Harriman	(262)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 5.403	AUD 8.892	Brown Brothers Harriman	(98)	(0,00 %)
1/31/24	USD 4.056	EUR 3.751	Brown Brothers Harriman	(93)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 9.544	CAD 14.004	Brown Brothers Harriman	(70)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 1.920	CHF 1.808	Brown Brothers Harriman	(31)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 1.324	SEK 14.936	Brown Brothers Harriman	(19)	(0,00 %)
1/31/24	CNH 4.901	EUR 633	Brown Brothers Harriman	(10)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 5.657	USD 6.266	Brown Brothers Harriman	(9)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 342	JPY 61.876	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 342	JPY 61.876	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 720	EUR 834	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 720	EUR 834	Brown Brothers Harriman	(5)	(0,00 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,01 % (31. Dezember 2022: (0,06 %)) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	EUR 334	JPY 52.156	Brown Brothers Harriman	(2)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 17	CHF 18	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 17	CHF 18	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 46	AUD 76	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 47	AUD 91	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 47	AUD 91	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 82	CAD 120	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 84	CAD 143	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 84	CAD 143	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 162	EUR 188	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	SGD 260	EUR 180	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 321	CAD 470	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 369	JPY 57.391	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 552	GBP 480	Brown Brothers Harriman	(1)	(0,00 %)
1/31/24	GBP 0	CHF 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 0	CHF 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	CHF 0	EUR 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 1	AUD 1	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SEK 1	GBP 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 1	CNH 12	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SGD 1	GBP 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 1	AUD 2	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 1	CNH 12	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SGD 1	GBP 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 1	AUD 2	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,01 % (31. Dezember 2022: (0,06 %)) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	SGD 1	EUR 1	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SEK 1	GBP 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 2	CAD 3	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	CHF 2	EUR 3	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SEK 2	EUR 0	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 3	CAD 5	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 3	SEK 28	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 3	CAD 5	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 5	GBP 4	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	CNH 6	EUR 1	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 11	SEK 128	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 12	SEK 152	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 12	SEK 152	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 16	CHF 16	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 21	EUR 24	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 21	EUR 24	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 37	USD 41	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 49	USD 62	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 49	USD 62	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 67	CNH 527	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 79	SGD 132	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	GBP 79	SGD 132	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	SGD 95	EUR 65	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	EUR 114	AUD 185	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	JPY 998	GBP 6	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,01 % (31. Dezember 2022: (0,06 %)) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	JPY 998	GBP 6	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	JPY 1.212	EUR 8	Brown Brothers Harriman	0	(0,00 %)
1/31/24	CHF 36	EUR 38	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	EUR 77	SGD 112	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	EUR 122	GBP 105	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	AUD 158	EUR 96	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	CAD 318	EUR 217	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	SEK 421	EUR 37	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	GBP 287	CNH 2.580	Brown Brothers Harriman	3	0,00 %
1/31/24	GBP 287	CNH 2.580	Brown Brothers Harriman	3	0,00 %
1/31/24	EUR 281	CNH 2.175	Brown Brothers Harriman	4	0,00 %
1/31/24	JPY 285.041	EUR 1.831	Brown Brothers Harriman	6	0,00 %
1/31/24	GBP 1.417	USD 1.776	Brown Brothers Harriman	32	0,00 %
1/31/24	GBP 1.417	USD 1.776	Brown Brothers Harriman	32	0,00 %
1/31/24	EUR 1.385	USD 1.497	Brown Brothers Harriman	35	0,00 %
1/31/24	EUR 8.977	SGD 13.009	Brown Brothers Harriman	53	0,00 %
1/31/24	EUR 14.228	GBP 12.270	Brown Brothers Harriman	90	0,00 %
1/31/24	EUR 32.682	CNH 253.286	Brown Brothers Harriman	503	0,00 %
1/31/24	EUR 161.335	USD 174.340	Brown Brothers Harriman	4.093	0,03 %
3/20/24	HUF 15.793.000	EUR 40.907	Goldman Sachs	(79)	(0,00 %)
3/20/24	EUR 69.510	NOK 816.000	HSBC Bank	(3.463)	(0,02 %)
3/20/24	CAD 208.000	USD 153.412	Royal Bank of Canada	4.499	0,03 %
3/20/24	USD 299.369	ZAR 5.718.000	UBS Securities LLC	(11.187)	(0,07 %)
3/20/24	USD 76.337	AUD 116.000	UBS Securities LLC	(3.001)	(0,02 %)
3/20/24	USD 45.185	MXN 800.000	UBS Securities LLC	(1.462)	(0,01 %)
3/20/24	EUR 111.450	DKK 830.000	UBS Securities LLC	16	0,00 %

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,01 % (31. Dezember 2022: (0,06 %)) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				41.757	0,26 %
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten				(39.221)	(0,25 %)
Nicht realisierter Nettogewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				**2.536**	**0,01 %**

Futures - 0,03 % (31. Dezember 2022: (0,01 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Kontrahent	Engagement	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	% des Nettovermögens
(7)	Euro-Bund March 2024 Futures	JP Morgan	1.037.476	(23.584)	(0,15 %)
(7)	US 5 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	747.052	(14.362)	(0,09 %)
(1)	US Long Bond March 2024 Futures	JP Morgan	116.172	(8.765)	(0,05 %)
2	Euro-Buxl 30 Year Bond March 2024 Futures	JP Morgan	287.607	25.495	0,16 %
3	Euro-Schatz March 2024 Futures	JP Morgan	351.950	1.135	0,01 %
1	Long Gilt March 2024 Futures	JP Morgan	122.636	8.223	0,05 %
5	US 10 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	548.047	16.406	0,10 %
Nicht realisierter Gewinn aus Futures				51.259	0,32 %
Nicht realisierter Verlust aus Futures				(46.711)	(0,29 %)
Nicht realisierter Nettogewinn auf Futures				**4.548**	**0,03 %**

	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**15.536.180**	**96,99**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(85.932)**	**(0,54)**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**15.450.248**	**96,45**
Bankguthaben	506.081	3,16
Sonstige Vermögenswerte	201.479	1,26
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(139.011)	(0,87)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**16.018.797**	**100,00**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

ZEHN GRÖSSTE BETEILIGUNGEN NACH SEKTOREN ZUM 31. Dezember 2023 IN PROZENT DES NETTOVERMÖGENS

Staatsanleihen	51,27 %
Banken	12,82 %
Sicherheiten UMBS	12,71 %
Ausländische Lokalregierungen	3,03 %
Gesundheit	2,54 %
Elektro	2,31 %
Telekommunikation	1,93 %
Pharmawerte	1,14 %
Supranationale Anleihen	1,00 %
Fluggesellschaften	0,89 %

(i) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(ii) Wertpapiere, die nach Rule 144A (i) des U.S. Securities Act aus dem Jahr 1933 nicht registriert werden müssen. Sie können im Rahmen von registrierungsfreien Transaktionen veräußert werden, in der Regel an entsprechend qualifizierte institutionelle Anleger.
(iii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
* Nicht börsennotierte Wertpapiere.

Sonstige Informationen:
Die zuvor genannten langfristigen Wertpapiere werden, sofern nicht anders angegeben, an geregelten Märkten gehandelt.

Abkürzungen:

AUD:	Australischer Dollar
BRL:	Brasilianischer Real
CAD:	Kanadischer Dollar
CHF:	Schweizer Franken
CNH:	Chinesischer Yuan
CNY:	Chinesischer Renminbi-Yuan
DKK:	Dänische Krone
EUR:	Euro
GBP:	Britisches Pfund
HUF:	Ungarischer Forint
IDR:	Indonesische Rupiah
ILS:	Israelischer Neuer Schekel
JPY:	Japanischer Yen
KRW:	Koreanischer Won
MXN:	Mexikanischer Peso
MYR:	Malaysischer Ringgit
NOK:	Norwegische Krone
NZD:	Neuseeländischer Dollar
PLN:	Polnischer Zloty
SEK:	Schwedische Krone
SGD:	Singapur-Dollar
THB:	Thailändischer Baht
USD:	US-Dollar
ZAR:	Südafrikanischer Rand

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögen**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	69,80
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	24,58
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an offiziellen Börsen notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden.	1,25
Finanzderivate	(0,01)
Umlaufvermögen	4,38
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nenn-Betrag	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 39,50 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 33,43 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 39,50 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 33,43 %)				
Kanada - 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,42 %)				
Suncor Energy Inc, 6,800 %, 15.05.38	USD	13.000	14.217	0,05
TransAlta Corp, 6,500 %, 15.03.40	USD	15.000	14.904	0,05
			29.121	0,10
Kaimaninseln - 2,61 % (31. Dezember 2022: 0,05 %)				
Gaci First Investment Co, 4,875 %, 14.02.35 (i)	USD	390.000	380.852	1,35
Gaci First Investment Co, 5,125 %, 14.02.53 (i)	USD	390.000	352.861	1,26
			733.713	2,61
Kolumbien - 1,55 % (31. Dezember 2022: 1,43 %)				
Colombian TES, 7,750 %, 18.09.30 (i)	COP	1.855.500.000	435.760	1,55
			435.760	1,55
Finnland - 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,02 %)				
Nokia OYJ, 6,625 %, 15.05.39 (i)	USD	5.000	4.945	0,02
			4.945	0,02
Indonesien - 0,35 % (31. Dezember 2022: 0,15 %)				
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15.09.30 (i)*	IDR	1.497.000.000	99.239	0,35
			99.239	0,35
Luxemburg - 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)				
Telecom Italia Capital SA, 7,721 %, 04.06.38 (i)	USD	4.000	4.073	0,01
			4.073	0,01
Malaysia - 0,97 % (31. Dezember 2022: 0,18 %)				
Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15.04.31 (i)*	MYR	1.360.000	273.383	0,97
			273.383	0,97
Mexiko - 1,97 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)				
Mexican Bonos, 7,750 %, 29.05.31 (i)	MXN	10.086.600	555.312	1,97
			555.312	1,97
Südafrika - 2,05 % (31. Dezember 2022: 0,19 %)				
Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31.01.30 (i)	ZAR	11.457.300	576.327	2,05
			576.327	2,05
Vereinigtes Königreich - 0,48 % (31. Dezember 2022: 0,56 %)				
Polyus Finance plc, 3,250 %, 14.10.28 144A (i) (ii)	USD	235.000	135.379	0,48
			135.379	0,48
Vereinigte Staaten - 27,09 % (31. Dezember 2022: 28,43 %)				
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, 06.04.26	USD	125.000	125.792	0,45
NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6,051 %, 01.03.25	USD	30.000	30.267	0,11
United States Treasury Bill, 5,255 %, 1/30/24	USD	2.523.000	2.512.430	8,92
United States Treasury Bill, 5,333 %, 2/15/24	USD	1.800.000	1.788.165	6,35
United States Treasury Bill, 5,340 %, 09.04.24	USD	2.365.000	2.330.872	8,28
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, 31.12.23	USD	840.000	840.000	2,98
			7.627.526	27,09
Uruguay - 2,30 % (31. Dezember 2022: 0,16 %)				
Republic of Uruguay, 8,250 %, 21.05.31 (i)	UYU	27.411.000	647.501	2,30
			647.501	2,30
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**11.122.279**	**39,50**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**11.122.279**	**39,50**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN – 37,79 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 47,04 %)				
Australien – 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Atlassian Corp	USD	20	4.757	0,02
			4.757	0,02
Österreich – 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Erste Group Bank AG	EUR	276	11.199	0,04
OMV AG	EUR	100	4.393	0,01
			15.592	0,05
Belgien – 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Ageas SA/NV	EUR	114	4.950	0,02
KBC Group NV	EUR	83	5.384	0,02
Solvay SA	EUR	27	827	0,00
Syensqo SA	EUR	27	2.812	0,01
			13.973	0,05
Bermuda - 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,01 %)				
Arch Capital Group Ltd	USD	249	18.493	0,07
Everest Group Ltd	USD	35	12.376	0,04
RenaissanceRe Holdings Ltd	USD	25	4.900	0,02
			35.769	0,13
Brasilien - 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,38 %)				
Alupar Investimento SA	BRL	3.120	20.239	0,07
Bradespar SA	BRL	4.100	21.658	0,08
Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG	BRL	4.700	19.816	0,07
Marcopolo SA	BRL	17.600	25.543	0,09
Metalurgica Gerdau SA	BRL	6.500	14.532	0,05
Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	BRL	2.000	11.701	0,04
NU Holdings Ltd	USD	582	4.848	0,02
Odontoprev SA	BRL	6.400	15.310	0,05
SLC Agricola SA	BRL	3.520	13.638	0,05
Unipar Carbocloro SA	BRL	1.100	17.344	0,06
XP Inc	USD	122	3.180	0,01
			167.809	0,59
Chile – 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Antofagasta PLC	GBP	124	2.655	0,01
Colbun SA	CLP	63.151	10.124	0,03
			12.779	0,04
China – 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,59 %)				
Hello Group Inc	USD	1.623	11.280	0,04
Jinan Acetate Chemical Co Ltd	TWD	648	16.849	0,06
			28.129	0,10
Dänemark – 0,14 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
AP Moller-Maersk A/S	DKK	5	8.876	0,03
AP Moller-Maersk A/S	DKK	5	8.995	0,03
Demant A/S	DKK	109	4.781	0,02
Novo Nordisk A/S	DKK	61	6.311	0,02
Orsted AS 144A (ii)	DKK	95	5.269	0,02
Pandora A/S	DKK	32	4.425	0,02
			38.657	0,14
Finland - 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Kesko OYJ	EUR	455	9.009	0,03
Metso OYJ	EUR	197	1.995	0,01
Nokia OYJ	EUR	1.025	3.456	0,01
Nordea Bank Abp	SEK	596	7.413	0,03

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Finnland - 0,12 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)				
Orion OYJ	EUR	110	4.772	0,02
Wartsila OYJ Abp	EUR	414	6.002	0,02
			32.647	0,12
Frankreich – 0,36 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
AXA SA	EUR	155	5.049	0,02
BNP Paribas SA	EUR	73	5.047	0,02
Bouygues SA	EUR	86	3.241	0,01
Carrefour SA	EUR	330	6.039	0,02
Cie de Saint-Gobain SA	EUR	51	3.755	0,01
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	EUR	117	4.195	0,02
Credit Agricole SA	EUR	781	11.088	0,04
Eiffage SA	EUR	32	3.430	0,01
Engie SA	EUR	301	5.293	0,02
EssilorLuxottica SA	EUR	12	2.407	0,01
Orange SA	EUR	574	6.533	0,02
Pernod Ricard SA	EUR	12	2.118	0,01
Publicis Groupe SA	EUR	63	5.846	0,02
Renault SA	EUR	75	3.058	0,01
Safran SA	EUR	35	6.165	0,02
Sanofi SA	EUR	47	4.660	0,02
Societe Generale SA	EUR	341	9.050	0,03
STMicroelectronics NV	EUR	43	2.149	0,01
Teleperformance SE	EUR	25	3.647	0,01
Veolia Environnement SA	EUR	157	4.953	0,02
Vivendi SE	EUR	239	2.555	0,01
			100.278	0,36
Deutschland – 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
BASF SE	EUR	104	5.604	0,02
Bayerische Motoren Werke AG	EUR	75	8.350	0,03
Commerzbank AG	EUR	409	4.861	0,02
Continental AG	EUR	31	2.634	0,01
Daimler Truck Holding AG	EUR	84	3.157	0,01
Deutsche Bank AG	EUR	285	3.893	0,01
Deutsche Lufthansa AG	EUR	370	3.289	0,01
Deutsche Post AG	EUR	74	3.667	0,01
Deutsche Telekom AG	EUR	141	3.388	0,01
Evonik Industries AG	EUR	255	5.211	0,02
Fresenius SE & Co KGaA	EUR	94	2.915	0,01
Heidelberg Materials AG	EUR	98	8.762	0,03
HelloFresh SE	EUR	66	1.043	0,00
Infineon Technologies AG	EUR	171	7.140	0,02
Mercedes-Benz Group AG	EUR	109	7.531	0,03
Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München	EUR	6	2.486	0,01
Porsche Automobil Holding SE	EUR	59	3.019	0,01
Puma SE	EUR	34	1.897	0,01
Rheinmetall AG	EUR	16	5.073	0,02
RWE AG	EUR	80	3.639	0,01
SAP SE	EUR	17	2.619	0,01
Siemens AG	EUR	40	7.508	0,03
Symrise AG	EUR	23	2.532	0,01
Volkswagen AG	EUR	64	7.904	0,03

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Deutschland – 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)				
Wacker Chemie AG	EUR	64	8.081	0,03
Zalando SE 144A (ii)	EUR	84	1.990	0,01
			118.193	0,42
Griechenland – 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,04 %)				
Motor Oil Hellas Corinth Refineries SA	EUR	445	11.680	0,04
			11.680	0,04
Hongkong - 0,01 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)				
Prudential PLC	GBP	190	2.149	0,01
			2.149	0,01
Indien – 2,39 % (31. Dezember 2022: 1,69 %)				
Action Construction Equipment Ltd	INR	2.088	20.967	0,07
Ajanta Pharma Ltd	INR	455	11.357	0,04
Apar Industries Ltd	INR	335	24.143	0,09
Canara Bank	INR	4.731	24.873	0,09
Chambal Fertilisers & Chemicals Ltd	INR	5.646	25.372	0,09
Chennai Petroleum Corp Ltd.	INR	2.739	22.975	0,08
Coromandel International Ltd	INR	1.407	21.152	0,08
Cummins India Ltd	INR	921	21.768	0,08
Cyient Ltd	INR	726	19.898	0,07
EIH Ltd	INR	3.658	10.946	0,04
Finolex Cables Ltd	INR	1.588	20.436	0,07
Fortis Healthcare Ltd	INR	2.521	12.695	0,05
Glenmark Pharmaceuticals Ltd	INR	1.662	17.017	0,06
Granules India Ltd	INR	2.166	10.529	0,04
Gujarat Narmada Valley Fertilizers & Chemicals Ltd	INR	1.323	11.940	0,04
Hindustan Copper Ltd	INR	6.028	19.696	0,07
Indian Bank	INR	2.765	14.002	0,05
IRCON International Ltd 144A (ii)	INR	10.514	21.650	0,08
Karnataka Bank Ltd	INR	7.932	22.286	0,08
Karur Vysya Bank Ltd	INR	6.282	12.705	0,05
L&T Technology Services Ltd 144A (ii)	INR	252	15.875	0,06
Mahanagar Gas Ltd	INR	1.218	17.559	0,06
Motilal Oswal Financial Services Ltd	INR	1.544	23.039	0,08
Narayana Hrudayalaya Ltd	INR	797	11.493	0,04
National Aluminium Co Ltd	INR	9.461	15.036	0,05
NCC Ltd	INR	11.104	22.258	0,08
Oracle Financial Services Software Ltd	INR	401	20.384	0,07
Persistent Systems Ltd	INR	162	14.387	0,05
Praj Industries Ltd	INR	2.218	14.846	0,05
Raymond Ltd	INR	822	17.021	0,06
REC Ltd	INR	4.707	23.277	0,08
Schaeffler India Ltd	INR	453	17.420	0,06
Sun TV Network Ltd	INR	2.430	20.789	0,07
Tanla Platforms Ltd	INR	544	7.165	0,03
Tata Communications Ltd	INR	595	12.656	0,04
Torrent Power Ltd	INR	777	8.712	0,03
Triveni Turbine Ltd	INR	3.817	19.391	0,07
Zensar Technologies Ltd	INR	3.283	24.066	0,09
			671.781	2,39

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Indonesien – 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,24%)				
AKR Corporindo Tbk PT	IDR	80.600	7.721	0,02
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	IDR	145.600	10.686	0,04
			18.407	0,06
Irland - 0,20 % (31. Dezember 2022: 0,17 %)				
AerCap Holdings NV	USD	68	5.054	0,02
AIB Group PLC	EUR	992	4.252	0,01
Allegion PLC	USD	137	17.356	0,06
Bank of Ireland Group PLC	EUR	510	4.630	0,02
DCC PLC	GBP	65	4.788	0,02
ICON PLC	USD	31	8.775	0,03
Smurfit Kappa Group PLC	EUR	92	3.646	0,01
Trane Technologies plc	USD	38	9.268	0,03
			57.769	0,20
Italien – 0,21 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Assicurazioni Generali SpA	EUR	259	5.466	0,02
Enel SpA	EUR	1.420	10.557	0,03
ENI SpA	EUR	299	5.069	0,02
Ferrari NV	EUR	9	3.034	0,01
Infrastrutture Wireless Italiane SpA 144A (ii)	EUR	174	2.201	0,01
Intesa Sanpaolo SpA	EUR	2.784	8.130	0,03
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	EUR	524	6.486	0,02
Poste Italiane SpA 144A (ii)	EUR	445	5.051	0,02
Snam SpA	EUR	970	4.988	0,02
UniCredit SpA	EUR	298	8.086	0,03
			59.068	0,21
Luxemburg - 0,02 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)				
ArcelorMittal SA	EUR	124	3.517	0,01
Ardagh Metal Packaging SA	USD	882	3.387	0,01
			6.904	0,02
Malaysia – 0,06 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)				
Inari Amertron Bhd	MYR	25.200	16.508	0,06
			16.508	0,06
Mexiko – 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,40 %)				
Alsea SAB de CV	MXN	5.392	20.489	0,07
Banco del Bajio SA 144A (ii)	MXN	4.891	16.376	0,06
			36.865	0,13
Niederlande - 0,25 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
ABN AMRO Bank NV 144A (ii)	EUR	559	8.392	0,03
Akzo Nobel NV	EUR	29	2.397	0,01
Argenx SE	EUR	4	1.518	0,00
ASML Holding NV	EUR	8	6.024	0,02
DSM BV	EUR	23	2.898	0,01
Heineken NV	EUR	23	2.336	0,01
ING Groep NV	EUR	877	13.104	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	98	2.816	0,01
NN Group NV	EUR	123	4.857	0,02
Prosus NV	EUR	68	2.027	0,01
QIAGEN NV	EUR	309	13.424	0,05
Stellantis NV	EUR	491	11.471	0,04
			71.264	0,25

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Norwegen – 0,13 % (31. Dezember 2022: 0,00%)				
Aker BP ASA	NOK	283	8.234	0,03
DNB Bank ASA	NOK	330	7.019	0,02
Norsk Hydro ASA	NOK	1.374	9.254	0,03
Telenor ASA	NOK	640	7.348	0,03
Yara International ASA	NOK	127	4.517	0,02
			36.372	0,13
Polen – 0,10 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)				
Alior Bank SA	PLN	576	11.182	0,04
ORLEN SA	PLN	1.091	18.173	0,06
			29.355	0,10
Portugal – 0,03 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
EDP – Energias de Portugal SA	EUR	477	2.400	0,01
Galp Energia SGPS SA	EUR	353	5.202	0,02
Jeronimo Martins SGPS SA	EUR	93	2.367	0,00
			9.969	0,03
Puerto Rico – 0,04 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Popular Inc	USD	134	10.997	0,04
			10.997	0,04
Saudi-Arabien – 0,32 % (31. Dezember 2022: 0,22 %)				
Abdullah Al Othaim Markets Co	SAR	2.953	10.316	0,04
Al Hammadi Holding	SAR	1.264	20.123	0,07
Almunajem Foods Co	SAR	989	19.068	0,07
Astra Industrial Group	SAR	783	27.603	0,10
Leejam Sports Co JSC	SAR	225	12.132	0,04
			89.242	0,32
Südafrika – 0,28 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)				
AVI Ltd	ZAR	2.896	12.997	0,04
Investec Ltd	ZAR	1.904	13.076	0,05
Momentum Metropolitan Holdings	ZAR	16.914	20.246	0,07
Sappi Ltd	ZAR	3.294	7.961	0,03
Thungela Resources Ltd	ZAR	581	4.886	0,02
Truworths International Ltd	ZAR	4.623	18.795	0,07
			77.961	0,28
Südkorea - 1,03 % (31. Dezember 2022: 0,95 %)				
BNK Financial Group Inc	KRW	1.533	8.499	0,03
Chong Kun Dang Pharmaceutical Corp	KRW	248	25.206	0,09
Daewoong Pharmaceutical Co Ltd	KRW	88	7.981	0,03
DB HiTek Co Ltd	KRW	299	13.605	0,05
Hansae Co Ltd.	KRW	311	5.083	0,02
Hanwha Aerospace Co Ltd.	KRW	214	20.687	0,07
Hanwha Life Insurance Co Ltd.	KRW	10.163	22.332	0,08
Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	KRW	721	17.355	0,06
Hyundai Rotem Co Ltd.	KRW	754	15.573	0,06
JW Pharmaceutical Corp	KRW	380	10.489	0,04
JYP Entertainment Corp	KRW	185	14.551	0,05
KEPCO Engineering & Construction Co Inc	KRW	228	10.994	0,04
LOTTE Fine Chemical Co Ltd	KRW	173	7.791	0,03
LX INTERNATIONAL CORP	KRW	543	12.395	0,04
NongShim Co Ltd.	KRW	29	9.164	0,03
OCI Holdings Co Ltd.	KRW	308	25.398	0,09
PharmaResearch Co Ltd	KRW	191	16.239	0,06
SL Corp	KRW	516	14.303	0,05

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Südkorea - 1,03 % (31. Dezember 2022: 0,95 %) (Fortsetzung)				
SM Entertainment Co Ltd	KRW	136	9.726	0,03
YG Entertainment Inc	KRW	226	8.932	0,03
Youngone Corp	KRW	386	13.667	0,05
			289.970	1,03
Spanien – 0,27 % (31. Dezember 2022: 0,00%)				
Acciona SA	EUR	43	6.332	0,02
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	EUR	179	7.941	0,03
Aena SME SA 144A (ii)	EUR	26	4.713	0,02
Amadeus IT Group SA	EUR	69	4.945	0,02
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	EUR	1.332	12.104	0,04
Banco Santander SA	EUR	1.282	5.352	0,02
CaixaBank SA	EUR	1.218	5.013	0,02
Enagas SA	EUR	352	5.936	0,02
Endesa SA	EUR	371	7.565	0,03
Grifols SA	EUR	167	2.851	0,01
Redeia Corp SA	EUR	422	6.951	0,02
Repsol SA	EUR	187	2.778	0,01
Telefonica SA	EUR	1.123	4.384	0,01
			76.865	0,27
Schweden – 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Beijer Ref AB	SEK	194	2.597	0,01
Embracer Group AB	SEK	2.454	6.661	0,02
Evolution AB 144A (ii)	SEK	21	2.505	0,01
H & M Hennes & Mauritz AB	SEK	289	5.065	0,02
Industrivarden AB	SEK	214	6.971	0,03
Investor AB	SEK	109	2.525	0,01
Investor AB	SEK	221	5.077	0,02
Nibe Industrier AB	SEK	492	3.456	0,01
Saab AB	SEK	85	5.125	0,02
Sandvik AB	SEK	115	2.489	0,01
Securitas AB	SEK	404	3.952	0,01
Skanska AB	SEK	189	3.420	0,01
SKF AB	SEK	354	7.071	0,03
Spotify Technology SA	USD	18	3.382	0,01
Swedbank AB	SEK	113	2.280	0,01
Tele2 AB	SEK	699	6.002	0,02
Telia Co AB	SEK	3.769	9.623	0,03
Volvo AB	SEK	228	5.921	0,02
			84.122	0,30
Schweiz – 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,09 %)				
Alcon Inc	CHF	27	2.106	0,01
Avolta AG	CHF	56	2.201	0,01
BKW AG	CHF	18	3.197	0,01
Clariant AG	CHF	132	1.948	0,01
Coca-Cola HBC AG	GBP	208	6.112	0,02
Givaudan SA	CHF	1	4.139	0,01
Glencore PLC	GBP	1.441	8.672	0,03
Holcim AG	CHF	67	5.256	0,02
Logitech International SA	CHF	31	2.938	0,01
Roche Holding AG	CHF	10	3.106	0,01
Roche Holding AG	CHF	11	3.196	0,01
Sika AG	CHF	8	2.602	0,01

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Schweiz - 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,09 %) (Fortsetzung)				
Sonova Holding AG	CHF	13	4.238	0,02
Straumann Holding AG	CHF	15	2.417	0,01
Swiss Re AG	CHF	91	10.224	0,04
Temenos AG	CHF	26	2.416	0,01
UBS Group AG	CHF	300	9.303	0,03
VAT Group AG 144A (ii)	CHF	8	4.006	0,01
Zurich Insurance Group AG	CHF	11	5.745	0,02
			83.822	0,30
Taiwan – 2,18 % (31. Dezember 2022: 1,16 %)				
Alexander Marine Co Ltd	TWD	495	6.145	0,02
Asia Vital Components Co Ltd	TWD	1.900	20.832	0,07
Bora Pharmaceuticals Co Ltd.	TWD	1.298	27.025	0,10
Chicony Electronics Co Ltd	TWD	3.800	21.668	0,08
China Motor Corp	TWD	7.000	25.774	0,09
Elitegroup Computer Systems Co Ltd.	TWD	9.000	9.237	0,03
Ever Supreme Bio Technology Co Ltd	TWD	1.099	7.001	0,02
Fitipower Integrated Technology Inc	TWD	2.600	21.815	0,08
Flexium Interconnect Inc	TWD	3.000	8.631	0,03
Formosa International Hotels Corp	TWD	1.900	13.713	0,05
Getac Holdings Corp	TWD	7.000	25.317	0,09
Global Mixed Mode Technology Inc	TWD	2.000	17.204	0,06
Great Tree Pharmacy Co Ltd	TWD	1.228	13.984	0,05
ITE Technology Inc	TWD	4.000	19.615	0,07
King Yuan Electronics Co Ltd	TWD	4.000	11.065	0,04
L&K Engineering Co Ltd.	TWD	4.000	22.157	0,08
Primax Electronics Ltd	TWD	11.000	24.265	0,09
Radiant Opto-Electronics Corp	TWD	5.000	21.668	0,08
Raydium Semiconductor Corp	TWD	2.000	26.099	0,09
Sanyang Motor Co Ltd	TWD	4.000	9.306	0,03
Sercomm Corp	TWD	6.000	26.295	0,09
Simplo Technology Co Ltd	TWD	1.700	23.265	0,08
Sino-American Silicon Products Inc	TWD	3.000	19.159	0,07
Sitronix Technology Corp	TWD	2.000	18.116	0,06
Sporton International Inc	TWD	2.100	16.490	0,06
Taiwan Fertilizer Co Ltd.	TWD	11.000	24.229	0,09
Taiwan Surface Mounting Technology Corp	TWD	6.795	21.233	0,08
Tong Yang Industry Co Ltd	TWD	8.000	19.811	0,07
Tripod Technology Corp	TWD	1.000	6.354	0,02
Tung Ho Steel Enterprise Corp	TWD	11.000	25.340	0,09
United Integrated Services Co Ltd	TWD	1.000	8.618	0,03
Wowprime Corp	TWD	3.199	26.006	0,09
Yankey Engineering Co Ltd.	TWD	1.000	10.296	0,04
Yulon Finance Corp	TWD	2.702	16.376	0,06
			614.109	2,18
Thailand – 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,25 %)				
Chularat Hospital PCL	THB	141.600	13.026	0,05
Ichitan Group PCL	THB	47.800	21.987	0,08
Sri Trang Agro-Industry PCL	THB	12.600	5.943	0,02
Srinanaporn Marketing PCL	THB	18.600	9.591	0,03
Thanachart Capital PCL	THB	11.600	16.823	0,06
WHA Corp PCL	THB	121.600	18.882	0,07
			86.252	0,31

Vermögensaufstellung				**Zum 31. Dezember 2023**
		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Türkei - 0,22 % (31. Dezember 2022: 0,00%)				
Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS	TRY	1.205	5.610	0,02
Dogus Otomotiv Servis ve Ticaret AS	TRY	2.356	20.501	0,07
Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret AS 144A (ii)	TRY	4.728	18.650	0,07
Turk Traktor ve Ziraat Makineleri AS	TRY	675	16.273	0,06
			61.034	0,22
Vereinigtes Königreich – 1,02 % (31. Dezember 2022: 0,19%)				
3i Group PLC	GBP	314	9.691	0,03
abrdn PLC	GBP	2.466	5.616	0,02
Admiral Group PLC	GBP	96	3.285	0,01
Amcor PLC	USD	301	2.902	0,01
AstraZeneca PLC	GBP	16	2.162	0,01
Aviva PLC	GBP	1.100	6.096	0,02
Barclays PLC	GBP	1.605	3.146	0,01
Barratt Developments PLC	GBP	808	5.795	0,02
British American Tobacco PLC	GBP	240	7.023	0,03
BT Group PLC	GBP	5.341	8.415	0,03
Centrica PLC	GBP	3.848	6.899	0,02
CNH Industrial NV	EUR	1.860	22.686	0,08
Ferguson PLC	USD	73	14.094	0,05
GSK PLC	GBP	161	2.976	0,01
HSBC Holdings PLC	GBP	967	7.834	0,03
Imperial Brands PLC	GBP	442	10.179	0,04
InterContinental Hotels Group PLC	GBP	59	5.333	0,02
J Sainsbury PLC	GBP	726	2.801	0,01
Janus Henderson Group PLC	USD	389	11.728	0,04
Kingfisher PLC	GBP	1.980	6.141	0,02
Legal & General Group PLC	GBP	2.156	6.901	0,03
M&G PLC	GBP	1.893	5.367	0,02
NatWest Group PLC	GBP	3.547	9.921	0,04
Next PLC	GBP	32	3.312	0,01
Ocado Group PLC	GBP	246	2.378	0,01
Pentair PLC	USD	116	8.434	0,03
Persimmon PLC	GBP	345	6.109	0,02
Phoenix Group Holdings PLC	GBP	745	5.083	0,02
RELX PLC	GBP	103	4.084	0,01
Rio Tinto PLC	GBP	78	5.809	0,02
Rolls-Royce Holdings PLC	GBP	1.533	5.857	0,02
Sage Group PLC	GBP	184	2.750	0,01
Severn Trent PLC	GBP	73	2.400	0,01
SSE PLC	GBP	264	6.246	0,02
St James's Place PLC	GBP	463	4.035	0,01
Standard Chartered PLC	GBP	231	1.963	0,01
Taylor Wimpey PLC	GBP	3.167	5.937	0,02
TechnipFMC PLC	USD	413	8.318	0,03
United Utilities Group PLC	GBP	178	2.404	0,01
Vodafone Group PLC	GBP	9.232	8.069	0,03
Willis Towers Watson PLC	USD	117	28.220	0,10
Wise PLC	GBP	470	5.237	0,02
WPP PLC	GBP	332	3.187	0,01
			286.823	1,02
USA – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %)				
3M Co	USD	107	11.697	0,04
AbbVie Inc	USD	280	43.392	0,15

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Acuity Brands Inc	USD	46	9.422	0,03
Adobe Inc	USD	34	20.284	0,07
ADT Inc	USD	842	5.742	0,02
Advanced Drainage Systems Inc	USD	55	7.735	0,03
AES Corp	USD	946	18.210	0,06
Affiliated Managers Group Inc	USD	110	16.656	0,06
Affirm Holdings Inc	USD	134	6.585	0,02
AGCO Corp	USD	245	29.745	0,11
Agilent Technologies Inc	USD	308	42.821	0,15
agilon health Inc	USD	270	3.388	0,01
Air Lease Corp	USD	210	8.807	0,03
Airbnb Inc	USD	150	20.421	0,07
Alaska Air Group Inc	USD	402	15.706	0,06
Albemarle Corp	USD	123	17.771	0,06
Albertsons Cos Inc	USD	811	18.653	0,07
Align Technology Inc	USD	17	4.658	0,02
Alliant Energy Corp	USD	204	10.465	0,04
Allison Transmission Holdings Inc	USD	547	31.808	0,11
Alphabet Inc	USD	605	84.512	0,30
Alphabet Inc	USD	612	86.249	0,31
Altria Group Inc	USD	935	37.718	0,13
Amazon.com Inc	USD	324	49.229	0,17
AMC Entertainment Holdings Inc	USD	601	3.678	0,01
Amdocs Ltd	USD	121	10.635	0,04
Ameren Corp	USD	133	9.621	0,03
American Airlines Group Inc	USD	1.009	13.864	0,05
American Electric Power Co Inc	USD	230	18.681	0,07
Ameriprise Financial Inc	USD	58	22.030	0,08
Amgen Inc	USD	130	37.443	0,13
Antero Midstream Corp	USD	231	2.894	0,01
Aon PLC	USD	88	25.610	0,09
APA Corp	USD	757	27.161	0,10
Apellis Pharmaceuticals Inc	USD	115	6.884	0,02
Apollo Global Management Inc	USD	97	9.039	0,03
Apple Inc	USD	521	100.308	0,36
Applied Materials Inc	USD	105	17.017	0,06
AppLovin Corp	USD	127	5.061	0,02
Aramark	USD	188	5.283	0,02
Archer-Daniels-Midland Co	USD	108	7.800	0,03
Ares Management Corp	USD	46	5.470	0,02
Arista Networks Inc	USD	26	6.123	0,02
Arrow Electronics Inc	USD	66	8.068	0,03
AT&T Inc	USD	1.372	23.022	0,08
Atmos Energy Corp	USD	153	17.733	0,06
Autodesk Inc	USD	69	16.800	0,06
Automatic Data Processing Inc	USD	84	19.569	0,07
AutoNation Inc	USD	55	8.260	0,03
AutoZone Inc	USD	10	25.856	0,09
Avangrid Inc	USD	315	10.209	0,04
Avis Budget Group Inc	USD	88	15.599	0,06
Avnet Inc	USD	333	16.783	0,06
Axon Enterprise Inc	USD	26	6.717	0,02
AZEK Co Inc	USD	116	4.437	0,02

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Baker Hughes Co	USD	141	4.819	0,02
Bank OZK	USD	392	19.533	0,07
Becton Dickinson & Co	USD	40	9.753	0,03
Bentley Systems Inc	USD	70	3.653	0,01
Berkshire Hathaway Inc	USD	82	29.246	0,10
Best Buy Co Inc	USD	146	11.429	0,04
Blue Owl Capital Inc	USD	404	6.020	0,02
Booking Holdings Inc	USD	9	31.925	0,11
Boston Scientific Corp	USD	199	11.504	0,04
Boyd Gaming Corp	USD	104	6.511	0,02
Bright Horizons Family Solutions Inc	USD	88	8.293	0,03
Bristol-Myers Squibb Co	USD	671	34.429	0,12
Broadcom Inc	USD	14	15.627	0,06
Brookfield Renewable Corp	USD	233	6.708	0,02
Brown-Forman Corp	USD	341	19.471	0,07
Builders FirstSource Inc	USD	200	33.388	0,12
Burlington Stores Inc	USD	37	7.196	0,03
BWX Technologies Inc	USD	45	3.453	0,01
Cable One Inc	USD	12	6.679	0,02
Cadence Design Systems Inc	USD	14	3.813	0,01
Caesars Entertainment Inc	USD	108	5.063	0,02
Campbell Soup Co	USD	255	11.024	0,04
Cardinal Health Inc	USD	254	25.603	0,09
Carnival Corp	USD	349	6.470	0,02
Carrier Global Corp	USD	144	8.273	0,03
Casey's General Stores Inc	USD	27	7.418	0,03
Caterpillar Inc	USD	71	20.993	0,07
Cboe Global Markets Inc	USD	87	15.535	0,06
Celsius Holdings Inc	USD	81	4.416	0,02
Cencora Inc	USD	56	11.501	0,04
Centene Corp	USD	335	24.860	0,09
CenterPoint Energy Inc	USD	549	15.685	0,06
CF Industries Holdings Inc	USD	76	6.042	0,02
CH Robinson Worldwide Inc	USD	87	7.516	0,03
Charter Communications Inc	USD	14	5.442	0,02
Chemed Corp	USD	20	11.695	0,04
Chesapeake Energy Corp	USD	34	2.616	0,01
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	USD	8	18.296	0,07
Choice Hotels International Inc	USD	51	5.778	0,02
Church & Dwight Co Inc	USD	122	11.536	0,04
Churchill Downs Inc	USD	99	13.358	0,05
Cigna Corp	USD	55	16.470	0,06
Cintas Corp	USD	39	23.504	0,08
Citigroup Inc	USD	67	3.446	0,01
Citizens Financial Group Inc	USD	419	13.886	0,05
Clearway Energy Inc	USD	121	3.095	0,01
Clearway Energy Inc	USD	114	3.127	0,01
Clorox Co	USD	127	18.109	0,06
Cloudflare Inc	USD	87	7.244	0,03
CME Group Inc	USD	69	14.531	0,05
CMS Energy Corp	USD	188	10.917	0,04
CNA Financial Corp	USD	68	2.877	0,01
Coca-Cola Co	USD	708	41.722	0,15

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Coinbase Global Inc	USD	29	5.044	0,02
Colgate-Palmolive Co	USD	234	18.652	0,07
Columbia Banking System Inc	USD	139	3.709	0,01
Comcast Corp	USD	465	20.390	0,07
Comerica Inc	USD	262	14.622	0,05
Conagra Brands Inc	USD	375	10.747	0,04
Concentrix Corp	USD	110	10.803	0,04
Confluent Inc	USD	182	4.259	0,02
ConocoPhillips	USD	185	21.473	0,08
Consolidated Edison Inc	USD	117	10.643	0,04
Constellation Brands Inc	USD	125	30.219	0,11
Cooper Cos Inc	USD	23	8.704	0,03
Copart Inc	USD	220	10.780	0,04
Core & Main Inc	USD	104	4.203	0,02
Corebridge Financial Inc	USD	702	15.205	0,05
Corteva Inc	USD	212	10.159	0,04
Coterra Energy Inc	USD	104	2.654	0,01
Coupang Inc	USD	297	4.808	0,02
Crane Co	USD	33	3.899	0,01
Crane NXT Co	USD	148	8.417	0,03
Credit Acceptance Corp	USD	14	7.458	0,03
Crocs Inc	USD	73	6.819	0,02
Crowdstrike Holdings Inc	USD	111	28.341	0,10
CSX Corp	USD	202	7.003	0,02
Cummins Inc	USD	33	7.906	0,03
CVS Health Corp	USD	708	55.904	0,20
Darling Ingredients Inc	USD	155	7.725	0,03
DaVita Inc	USD	76	7.962	0,03
Deckers Outdoor Corp	USD	20	13.369	0,05
Deere & Co	USD	13	5.198	0,02
Delta Air Lines Inc	USD	353	14.201	0,05
Devon Energy Corp	USD	58	2.627	0,01
Discover Financial Services	USD	264	29.674	0,11
DISH Network Corp	USD	1.339	7.726	0,03
Dominion Energy Inc	USD	58	2.726	0,01
DoorDash Inc	USD	39	3.857	0,01
Dow Inc	USD	54	2.961	0,01
Doximity Inc	USD	314	8.805	0,03
DraftKings Inc	USD	96	3.384	0,01
Dropbox Inc	USD	186	5.483	0,02
DTE Energy Co	USD	99	10.916	0,04
Duke Energy Corp	USD	285	27.656	0,10
Eagle Materials Inc	USD	39	7.911	0,03
East West Bancorp Inc	USD	270	19.426	0,07
eBay Inc	USD	145	6.325	0,02
Ecolab Inc	USD	45	8.926	0,03
Edwards Lifesciences Corp	USD	109	8.311	0,03
Elastic NV	USD	238	26.823	0,10
Electronic Arts Inc	USD	89	12.176	0,04
Elevance Health Inc	USD	17	8.017	0,03
Eli Lilly & Co	USD	23	13.407	0,05
EMCOR Group Inc	USD	24	5.170	0,02
Enphase Energy Inc	USD	112	14.800	0,05

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Entergy Corp	USD	111	11.232	0,04
EOG Resources Inc	USD	79	9.555	0,03
Equitable Holdings Inc	USD	764	25.441	0,09
Esab Corp	USD	45	3.898	0,01
Estee Lauder Cos Inc	USD	146	21.353	0,08
Etsy Inc	USD	95	7.700	0,03
Evergy Inc	USD	348	18.166	0,06
Eversource Energy	USD	305	18.825	0,07
Exact Sciences Corp	USD	134	9.913	0,04
Exelon Corp	USD	264	9.478	0,03
Expedia Group Inc	USD	112	17.000	0,06
Expeditors International of Washington Inc	USD	66	8.395	0,03
FactSet Research Systems Inc	USD	64	30.531	0,11
Fair Isaac Corp	USD	3	3.492	0,01
FedEx Corp	USD	20	5.059	0,02
First Citizens BancShares Inc	USD	12	17.028	0,06
First Hawaiian Inc	USD	149	3.406	0,01
First Horizon Corp	USD	987	13.976	0,05
First Solar Inc	USD	30	5.168	0,02
FirstEnergy Corp	USD	294	10.778	0,04
FleetCor Technologies Inc	USD	23	6.500	0,02
Flowers Foods Inc	USD	470	10.580	0,04
FMC Corp	USD	173	10.908	0,04
Ford Motor Co	USD	656	7.997	0,03
Fortinet Inc	USD	181	10.594	0,04
Fortune Brands Innovations Inc	USD	121	9.213	0,03
GameStop Corp	USD	261	4.575	0,02
Gap Inc	USD	754	15.766	0,06
Gartner Inc	USD	18	8.120	0,03
Gen Digital Inc	USD	442	10.086	0,04
General Dynamics Corp	USD	49	12.724	0,05
General Electric Co	USD	203	25.909	0,09
General Mills Inc	USD	278	18.109	0,06
General Motors Co	USD	248	8.908	0,03
Gilead Sciences Inc	USD	502	40.667	0,14
Ginkgo Bioworks Holdings Inc	USD	3.018	5.100	0,02
Gitlab Inc	USD	112	7.052	0,03
Graphic Packaging Holding Co	USD	589	14.519	0,05
Guidewire Software Inc	USD	126	13.739	0,05
Harley-Davidson Inc	USD	476	17.536	0,06
Hasbro Inc	USD	113	5.770	0,02
Hawaiian Electric Industries Inc	USD	862	12.232	0,04
HCA Healthcare Inc	USD	32	8.662	0,03
Hershey Co	USD	82	15.288	0,05
Hertz Global Holdings Inc	USD	1.125	11.689	0,04
Hess Corp	USD	50	7.208	0,03
Hewlett Packard Enterprise Co	USD	955	16.216	0,06
HF Sinclair Corp	USD	146	8.113	0,03
Hilton Worldwide Holdings Inc	USD	128	23.308	0,08
Home Depot Inc	USD	130	45.052	0,16
Hormel Foods Corp	USD	276	8.862	0,03
HP Inc	USD	318	9.569	0,03
HubSpot Inc	USD	35	20.319	0,07

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Humana Inc	USD	35	16.023	0,06
Huntington Bancshares Inc	USD	263	3.345	0,01
Huntington Ingalls Industries Inc	USD	53	13.761	0,05
IAC Inc	USD	101	5.290	0,02
IDACORP Inc	USD	108	10.619	0,04
IDEX Corp	USD	106	23.014	0,08
IDEXX Laboratories Inc	USD	30	16.652	0,06
Illinois Tool Works Inc	USD	27	7.072	0,03
Incyte Corp	USD	84	5.274	0,02
Ingredion Inc	USD	107	11.613	0,04
Insulet Corp	USD	32	6.943	0,02
Integra LifeSciences Holdings Corp	USD	202	8.797	0,03
Intel Corp	USD	231	11.608	0,04
International Business Machines Corp	USD	123	20.117	0,07
International Paper Co	USD	79	2.856	0,01
Intuit Inc	USD	15	9.375	0,03
Invesco Ltd	USD	191	3.407	0,01
J M Smucker Co	USD	85	10.742	0,04
Jabil Inc	USD	154	19.620	0,07
Jack Henry & Associates Inc	USD	176	28.760	0,10
JB Hunt Transport Services Inc	USD	152	30.360	0,11
Johnson & Johnson	USD	162	25.392	0,09
JPMorgan Chase & Co	USD	201	34.190	0,12
KBR Inc	USD	127	7.037	0,03
Kellanova	USD	322	18.003	0,06
Kenvue Inc	USD	505	10.873	0,04
Keurig Dr Pepper Inc	USD	324	10.796	0,04
KeyCorp	USD	258	3.715	0,01
Keysight Technologies Inc	USD	705	112.158	0,40
Kimberly-Clark Corp	USD	267	32.443	0,12
Kinder Morgan Inc	USD	1.363	24.043	0,09
Kinsale Capital Group Inc	USD	36	12.057	0,04
KLA Corp	USD	14	8.138	0,03
Kohl’s Corp	USD	128	3.671	0,01
Kraft Heinz Co	USD	313	11.575	0,04
Kroger Co	USD	668	30.534	0,11
Kyndryl Holdings Inc	USD	518	10.764	0,04
Laboratory Corp of America Holdings	USD	215	48.867	0,17
Lam Research Corp	USD	28	21.931	0,08
Lamb Weston Holdings Inc	USD	66	7.134	0,03
Lattice Semiconductor Corp	USD	76	5.243	0,02
Lazard Ltd	USD	87	3.028	0,01
Lear Corp	USD	37	5.225	0,02
Leggett & Platt Inc	USD	108	2.826	0,01
Lennar Corp	USD	113	15.148	0,05
Lennox International Inc	USD	29	12.978	0,05
Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	USD	373	10.720	0,04
Lincoln National Corp	USD	109	2.940	0,01
Lithia Motors Inc	USD	28	9.220	0,03
Live Nation Entertainment Inc	USD	63	5.897	0,02
LKQ Corp	USD	767	36.655	0,13
Lowe's Cos Inc	USD	139	30.934	0,11
LyondellBasell Industries NV	USD	29	2.757	0,01

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Macy’s Inc	USD	1.650	33.198	0,12
Manhattan Associates Inc	USD	24	5.168	0,02
Marathon Petroleum Corp	USD	110	16.320	0,06
Maravai LifeSciences Holdings Inc	USD	661	4.330	0,02
Markel Group Inc	USD	3	4.260	0,02
Marriott International Inc	USD	111	25.032	0,09
Marsh & McLennan Cos Inc	USD	199	37.705	0,13
Mastercard Inc	USD	77	32.841	0,12
Match Group Inc	USD	1.020	37.230	0,13
McCormick & Co Inc	USD	141	9.647	0,03
McDonald's Corp	USD	39	11.564	0,04
McKesson Corp	USD	59	27.316	0,10
Medpace Holdings Inc	USD	46	14.100	0,05
Merck & Co Inc	USD	670	73.043	0,26
Mercury Systems Inc	USD	204	7.460	0,03
Meta Platforms Inc	USD	86	30.441	0,11
MetLife Inc	USD	249	16.466	0,06
Microchip Technology Inc	USD	191	17.224	0,06
Microsoft Corp	USD	566	212.839	0,76
Molson Coors Beverage Co	USD	120	7.345	0,03
Mondelez International Inc	USD	151	10.937	0,04
MongoDB Inc	USD	24	9.812	0,03
Monster Beverage Corp	USD	92	5.300	0,02
Moody's Corp	USD	20	7.811	0,03
Morgan Stanley	USD	92	8.579	0,03
Mosaic Co	USD	234	8.361	0,03
Motorola Solutions Inc	USD	23	7.201	0,03
MSCI Inc	USD	54	30.545	0,11
Natera Inc	USD	111	6.953	0,02
National Fuel Gas Co	USD	280	14.048	0,05
nCino Inc	USD	160	5.381	0,02
NetApp Inc	USD	112	9.874	0,04
Netflix Inc	USD	8	3.895	0,01
Neurocrine Biosciences Inc	USD	44	5.797	0,02
New Fortress Energy Inc	USD	248	9.357	0,03
New York Community Bancorp Inc	USD	2.001	20.470	0,07
NewMarket Corp	USD	7	3.821	0,01
Newmont Corp	USD	234	9.685	0,03
NiSource Inc	USD	675	17.921	0,06
Nordstrom Inc	USD	191	3.524	0,01
Northrop Grumman Corp	USD	25	11.704	0,04
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	USD	314	6.293	0,02
NOV Inc	USD	240	4.867	0,02
Nucor Corp	USD	104	18.100	0,06
NVIDIA Corp	USD	182	90.130	0,32
OGE Energy Corp	USD	305	10.654	0,04
Okta Inc	USD	139	12.584	0,04
Olaplex Holdings Inc	USD	3.018	7.666	0,03
Old Dominion Freight Line Inc	USD	15	6.080	0,02
OneMain Holdings Inc	USD	69	3.395	0,01
ONEOK Inc	USD	155	10.884	0,04
O'Reilly Automotive Inc	USD	19	18.052	0,06
Organon & Co	USD	614	8.854	0,03

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Oshkosh Corp	USD	80	8.673	0,03
Ovintiv Inc	USD	349	15.328	0,05
Owens Corning	USD	164	24.310	0,09
PACCAR Inc	USD	176	17.186	0,06
Palantir Technologies Inc	USD	905	15.539	0,06
Palo Alto Networks Inc	USD	106	31.257	0,11
Paychex Inc	USD	55	6.551	0,02
Paycom Software Inc	USD	118	24.393	0,09
Pegasystems Inc	USD	394	19.251	0,07
Penn Entertainment Inc	USD	603	15.690	0,06
Penumbra Inc	USD	20	5.031	0,02
PepsiCo Inc	USD	61	10.360	0,04
Performance Food Group Co	USD	82	5.670	0,02
Pfizer Inc	USD	566	16.295	0,06
PG&E Corp	USD	293	5.283	0,02
Philip Morris International Inc	USD	318	29.917	0,11
Phinia Inc	USD	319	9.663	0,03
Pinnacle West Capital Corp	USD	139	9.986	0,04
Pioneer Natural Resources Co	USD	12	2.699	0,01
Post Holdings Inc	USD	175	15.411	0,05
PPL Corp	USD	419	11.355	0,04
Premier Inc	USD	734	16.412	0,06
Primerica Inc	USD	17	3.498	0,01
Procter & Gamble Co	USD	113	16.559	0,06
Public Service Enterprise Group Inc	USD	408	24.949	0,09
PulteGroup Inc	USD	154	15.896	0,06
Pure Storage Inc	USD	417	14.870	0,05
Qorvo Inc	USD	915	103.038	0,37
QUALCOMM Inc	USD	76	10.992	0,04
Quest Diagnostics Inc	USD	146	20.130	0,07
R1 RCM Inc	USD	322	3.404	0,01
Regeneron Pharmaceuticals Inc	USD	8	7.026	0,03
Regions Financial Corp	USD	158	3.062	0,01
Republic Services Inc	USD	72	11.874	0,04
Reynolds Consumer Products Inc	USD	408	10.951	0,04
RLI Corp	USD	19	2.529	0,01
Robinhood Markets Inc	USD	507	6.459	0,02
Roivant Sciences Ltd	USD	547	6.143	0,02
Roper Technologies Inc	USD	21	11.449	0,04
Royal Caribbean Cruises Ltd	USD	224	29.006	0,10
Royalty Pharma PLC	USD	627	17.612	0,06
RYDER SYSTEM INC	USD	152	17.489	0,06
Saia Inc	USD	13	5.697	0,02
Salesforce Inc	USD	17	4.473	0,02
Science Applications International Corp	USD	100	12.432	0,04
Seaboard Corp	USD	6	21.421	0,08
Sealed Air Corp	USD	295	10.773	0,04
Sempra	USD	147	10.985	0,04
SentinelOne Inc	USD	323	8.863	0,03
ServiceNow Inc	USD	5	3.532	0,01
Shift4 Payments Inc	USD	91	6.765	0,02
Shockwave Medical Inc	USD	33	6.288	0,02
SiteOne Landscape Supply Inc	USD	49	7.963	0,03

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
Skyworks Solutions Inc	USD	85	9.556	0,03
SLM Corp	USD	605	11.568	0,04
Smartsheet Inc	USD	87	4.160	0,01
Snowflake Inc	USD	90	17.910	0,06
SoFi Technologies Inc	USD	1.170	11.642	0,04
Sotera Health Co	USD	367	6.184	0,02
Southern Co	USD	152	10.658	0,04
Southern Copper Corp	USD	126	10.845	0,04
Southwest Airlines Co	USD	180	5.198	0,02
Southwestern Energy Co	USD	1.375	9.006	0,03
Spectrum Brands Holdings Inc	USD	62	4.946	0,02
Splunk Inc	USD	33	5.028	0,02
SSR Mining Inc	USD	352	3.788	0,01
Starbucks Corp	USD	196	18.818	0,07
Steel Dynamics Inc	USD	141	16.652	0,06
Synchrony Financial	USD	503	19.210	0,07
Synopsys Inc	USD	7	3.604	0,01
Synovus Financial Corp	USD	391	14.721	0,05
Sysco Corp	USD	264	19.306	0,07
Take-Two Interactive Software Inc	USD	24	3.863	0,01
Tandem Diabetes Care Inc	USD	400	11.832	0,04
Tapestry Inc	USD	290	10.675	0,04
TD SYNNEX Corp	USD	82	8.824	0,03
Tenet Healthcare Corp	USD	119	8.993	0,03
Teradata Corp	USD	77	3.350	0,01
Teradyne Inc	USD	976	105.916	0,38
Tesla Inc	USD	48	11.927	0,04
Texas Instruments Inc	USD	654	111.481	0,40
Texas Pacific Land Corp	USD	4	6.290	0,02
TFS Financial Corp	USD	229	3.364	0,01
Thermo Fisher Scientific Inc	USD	79	41.932	0,15
T-Mobile US Inc	USD	326	52.268	0,19
Toll Brothers Inc	USD	155	15.932	0,06
TopBuild Corp	USD	12	4.491	0,02
TPG Inc	USD	206	8.893	0,03
Tractor Supply Co	USD	171	36.770	0,13
Trade Desk Inc	USD	57	4.102	0,01
Tradeweb Markets Inc	USD	58	5.271	0,02
TransDigm Group Inc	USD	4	4.046	0,01
Travel + Leisure Co	USD	226	8.834	0,03
Travelers Cos Inc	USD	63	12.001	0,04
Trimble Inc	USD	153	8.140	0,03
Truist Financial Corp	USD	95	3.507	0,01
Twilio Inc	USD	86	6.525	0,02
Uber Technologies Inc	USD	168	10.344	0,04
UGI Corp	USD	426	10.480	0,04
U-Haul Holding Co	USD	145	10.411	0,04
U-Haul Holding Co	USD	153	10.777	0,04
UiPath Inc	USD	311	7.725	0,03
Under Armour Inc	USD	1.377	11.498	0,04
Union Pacific Corp	USD	121	29.720	0,11
United Airlines Holdings Inc	USD	577	23.807	0,08
United Rentals Inc	USD	15	8.601	0,03

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	Zeitwert USD	% des Nettovermögens
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Vereinigte Staaten – 25,82 % (31. Dezember 2022: 39,94 %) (Fortsetzung)				
United States Steel Corp	USD	259	12.600	0,04
United Therapeutics Corp	USD	66	14.513	0,05
UnitedHealth Group Inc	USD	92	48.435	0,17
Unity Software Inc	USD	160	6.542	0,02
Universal Display Corp	USD	32	6.120	0,02
Universal Health Services Inc	USD	65	9.909	0,04
Unum Group	USD	457	20.666	0,07
US Bancorp	USD	81	3.506	0,01
US Foods Holding Corp	USD	122	5.540	0,02
UWM Holdings Corp	USD	564	4.033	0,01
Vail Resorts Inc	USD	31	6.618	0,02
Valero Energy Corp	USD	163	21.190	0,08
Veeva Systems Inc	USD	31	5.968	0,02
VeriSign Inc	USD	70	14.417	0,05
Verisk Analytics Inc	USD	107	25.558	0,09
Verizon Communications Inc	USD	658	24.807	0,09
Vertex Pharmaceuticals Inc	USD	18	7.324	0,03
Vertiv Holdings Co	USD	224	10.759	0,04
VF Corp	USD	152	2.858	0,01
Viatris Inc	USD	2.054	22.245	0,08
Victoria's Secret & Co	USD	492	13.058	0,05
Virtu Financial Inc	USD	157	3.181	0,01
Visa Inc	USD	149	38.792	0,14
Vistra Corp	USD	1.098	42.295	0,15
Vontier Corp	USD	380	13.129	0,05
Walgreens Boots Alliance Inc	USD	128	3.342	0,01
Walmart Inc	USD	148	23.332	0,08
Waste Management Inc	USD	190	34.029	0,12
WATERS CORP	USD	51	16.791	0,06
WEC Energy Group Inc	USD	125	10.521	0,04
Wells Fargo & Co	USD	121	5.956	0,02
WESCO International Inc	USD	57	9.911	0,04
West Pharmaceutical Services Inc	USD	13	4.578	0,02
Western Alliance Bancorp	USD	184	12.105	0,04
Western Union Co	USD	207	2.467	0,01
Whirlpool Corp	USD	21	2.557	0,01
White Mountains Insurance Group Ltd	USD	10	15.050	0,05
Williams Cos Inc	USD	81	2.821	0,01
Williams-Sonoma Inc	USD	88	17.757	0,06
WillScot Mobile Mini Holdings Corp	USD	122	5.429	0,02
Workday Inc	USD	103	28.434	0,10
WW Grainger Inc	USD	11	9.116	0,03
Wynn Resorts Ltd	USD	216	19.680	0,07
Xcel Energy Inc	USD	427	26.436	0,09
XPO Inc	USD	41	3.591	0,01
Xylem Inc	USD	85	9.721	0,03
YETI Holdings Inc	USD	157	8.129	0,03
Yum! Brands Inc	USD	299	39.067	0,14
Zimmer Biomet Holdings Inc	USD	65	7.911	0,03
Zoetis Inc	USD	78	15.395	0,05
			7.270.665	25,82

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Anteile	**Zeitwert USD**	**% des Nettovermögens**
STAMMAKTIEN (Forts.)				
Uruguay – 0,05 % (31. Dezember 2022: 0,08 %)				
MercadoLibre Inc	USD	9	14.144	0,05
			14.144	0,05
STAMMAKTIEN, GESAMT			**10.642.680**	**37,79**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: USD 20.610.745)			**21.764.959**	**77,29**

FINANZDERIVATE – 0,79 % (31. Dezember 2022: 0,20 %)

Offene Devisenterminkontrakte – 1,98 % (31. Dezember 2022: 0,15 %)

Fälligkeits-datum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
1/24/24	USD 1.056.961	ILS 3.919.000	Bank of America	(31.830)	(0,11 %)
1/24/24	TRY 19.574.000	USD 651.171	Barclays Bank PLC	(1.198)	(0,01 %)
1/24/24	CAD 6.000	USD 4.412	Barclays Bank PLC	140	0,00 %
1/24/24	JPY 19.879.000	USD 137.372	Barclays Bank PLC	4.113	0,01 %
1/24/24	MXN 14.242.000	USD 813.411	Barclays Bank PLC	24.455	0,09 %
1/2/24	USD 27.976.815	EUR 25.364.149	Brown Brothers Harriman	(41.696)	(0,15 %)
1/2/24	USD 35.170	EUR 31.886	Brown Brothers Harriman	(52)	(0,00 %)
1/2/24	EUR 31.886	USD 34.459	Brown Brothers Harriman	764	0,00 %
1/2/24	EUR 25.364.149	USD 27.410.983	Brown Brothers Harriman	607.528	2,16 %
1/31/24	USD 27.408.601	EUR 25.364.149	Brown Brothers Harriman	(643.531)	(2,29 %)
1/31/24	USD 34.456	EUR 31.886	Brown Brothers Harriman	(809)	(0,00 %)
1/31/24	EUR 31.886	USD 35.170	Brown Brothers Harriman	95	0,00 %
1/31/24	EUR 31.886	USD 34.456	Brown Brothers Harriman	809	0,00 %
1/31/24	EUR 25.364.149	USD 27.976.815	Brown Brothers Harriman	75.317	0,27 %
1/31/24	EUR 25.364.149	USD 27.408.601	Brown Brothers Harriman	643.531	2,29 %

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 1,98 % (31. Dezember 2022: 0,15 %) (Fortsetzung)

Fälligkeits-datum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinns/ (Verlustes) USD	% des Nettovermögens
1/24/24	AUD 86.000	USD 56.419	Citibank NA	2.307	0,01 %
1/24/24	USD 8.398	NOK 92.000	Goldman Sachs	(666)	(0,00 %)
1/24/24	SEK 16.000	USD 1.529	Goldman Sachs	60	0,00 %
1/24/24	NZD 7.000	USD 4.292	Goldman Sachs	140	0,00 %
1/24/24	EUR 7.000	USD 7.563	Goldman Sachs	176	0,00 %
1/24/24	AUD 11.000	USD 7.233	Goldman Sachs	279	0,00 %
1/24/24	CHF 13.000	USD 14.907	Goldman Sachs	574	0,00 %
1/24/24	USD 695.617	EUR 644.000	HSBC Bank	(16.410)	(0,06 %)
1/24/24	USD 55.912	CAD 76.000	HSBC Bank	(1.743)	(0,01 %)
1/24/24	USD 16.306	GBP 13.000	HSBC Bank	(269)	(0,00 %)
1/24/24	NZD 60.000	USD 36.710	HSBC Bank	1.282	0,00 %
1/24/24	EUR 59.000	USD 63.729	HSBC Bank	1.503	0,01 %
1/24/24	GBP 111.000	USD 139.227	HSBC Bank	2.293	0,01 %
1/24/24	USD 820.092	JPY 118.538.000	Morgan Stanley Capital	(23.577)	(0,08 %)
1/24/24	USD 1.981.574	TWD 62.053.000	UBS Securities LLC	(45.900)	(0,16 %)
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				1.365.366	4,85 %
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten				(807.681)	(2,87 %)
Nicht realisierter Nettogewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				**557.685**	**1,98 %**

Futures - (1.19)% (31. Dezember 2022: 0,05 %)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Kontrahent	Engagement	Nicht realisierter Gewinn /(Verlust)	% des Nettovermögens
(8)	90 Day bank bill June 2024 Futures	JP Morgan	5.399.157	(5.141)	(0,02 %)
(8)	90 Day bank bill March 2024 Futures	JP Morgan	5.410.238	8.182	0,03 %
(8)	90 Day Bank Bill September 2024 Futures	JP Morgan	5.402.318	(4.092)	(0,01 %)
(25)	3 Month Euribor June 2024 Futures	JP Morgan	6.677.071	(12.966)	(0,05 %)
(35)	3 Month Euribor March 2024 Futures	JP Morgan	9.310.998	(4.791)	(0,02 %)

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Futures – (1,19) % (31. Dezember 2022: 0,05 %) (Fortsetzung)

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Kontrahent	Engagement	Nicht realisierter Gewinn (/Verlust)	% des Nettovermögens
(15)	3 Month Euribor September 2024 Futures	JP Morgan	3.996.417	(36.868)	(0,13 %)
(20)	3 Month SOFR December 2023 Futures	JP Morgan	4.754.000	21.875	0,08 %
(20)	3 Month SOFR March 2024 Futures	JP Morgan	4.771.375	20.625	0,07 %
(21)	3 Month SOFR September 2024 Futures	JP Morgan	5.037.638	2.625	0,01 %
(42)	10 Year Mini JGB March 2024 Futures	JP Morgan	4.323.635	(41.708)	(0,15 %)
(223)	CBOE Volatility Index January 2024 Futures	JP Morgan	3.257.070	123.652	0,44 %
(7)	E-mini Russell 2000 Index March 2024 Futures	JP Morgan	66.572	(5.097)	(0,02 %)
(40)	E-mini Russell 2000 Index March 2024 Futures	JP Morgan	3.804.000	(291.400)	(1,03 %)
(22)	Euro Stoxx 50 March 2024 Futures	JP Morgan	1.111.952	7.898	0,03 %
(2)	FTSE 100 Index March 2024 Futures	JP Morgan	193.030	(4.730)	(0,02 %)
(128)	Micro E-mini S&P 500 March 2024 Futures	JP Morgan	2.971.377	(113.423)	(0,40 %)
(4)	Micro-DAX March 2024 Futures	JP Morgan	74.992	261	0,00 %
(33)	MSCI Emerging Markets Index March 2024 Futures	JP Morgan	1.625.580	(80.025)	(0,28 %)
(6)	MSCI Singapore Index January 2024 Futures	JP Morgan	125.972	(4.890)	(0,02 %)
1	CAC 40 Index January 2024 Futures	JP Morgan	83.666	(210)	(0,00 %)
210	CBOE Volatility Index February 2024 Futures	JP Morgan	3.280.640	(68.606)	(0,24 %)
2	Mini FTSE MIB March 2024 Futures	JP Morgan	67.781	(351)	(0,00 %)
4	Mini Hang Seng Index January 2024 Futures	JP Morgan	85.995	1.765	0,01 %
1	Mini-DAX March 2024 Futures	JP Morgan	93.724	(309)	(0,00 %)
65	Nasdaq 100 Micro E-mini March 2024 Futures	JP Morgan	2.120.508	92.547	0,33 %
5	OMX Stockholm 30 Index January 2024 Futures	JP Morgan	117.657	1.478	0,00 %
15	US 10 Year Note March 2024 Futures	JP Morgan	1.636.641	56.719	0,20 %
11	WIG 20 Index March 2024 Futures	JP Morgan	131.436	1.104	0,00 %
	Nicht realisierter Gewinn aus Futures			338.731	1,20 %
	Nicht realisierter Verlust aus Futures			(674.607)	(2,39 %)
	Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures			**(335.876)**	**(1,19 %)**

Zentral geclearte Credit Default Index Swaps – 1,41 % (31. Dezember 2022: 0,06 %)

Position	Kontrahent	Zugrunde liegender Index	Satz	Fälligkeitsdatum	Währung	Nennwert	Nicht realisierte Gewinne/ (Verluste)	% des Nettovermögens
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	198.000	12.142	0,04 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	693.000	42.497	0,15 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	99.000	6.071	0,02 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	198.000	12.142	0,04 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	1.386.000	84.994	0,30 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.HY.40	5,00 %	20. Juni 2028	USD	396.000	24.284	0,09 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	100.000	2.010	0,01 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Crossover Series 39	5,00 %	20. Juni 2028	EUR	493.330	53.950	0,19 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Crossover Series 39	5,00 %	20. Juni 2028	EUR	98.666	10.790	0,04 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Crossover Series 39	5,00 %	20. Juni 2028	EUR	197.332	21.580	0,08 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Crossover Series 39	5,00 %	20. Juni 2028	EUR	1.479.990	161.848	0,57 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Crossover Series 39	5,00 %	20. Juni 2028	EUR	98.666	10.790	0,04 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	100.000	2.253	0,01 %
VERKAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	100.000	2.253	0,01 %
KAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	100.000	(2.010)	(0,01 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	600.000	(12.059)	(0,04 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	100.000	(2.010)	(0,01 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	300.000	(6.029)	(0,02 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	CDX.NA.IG.40	1,00 %	20. Juni 2028	USD	300.000	(6.030)	(0,02 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	200.000	(4.506)	(0,02 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	100.000	(2.253)	(0,01 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	100.000	(2.253)	(0,01 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	100.000	(2.253)	(0,01 %)
KAUF	Morgan Stanley Capital	iTRAXX Europe Series 39	1,00 %	20. Juni 2028	EUR	500.000	(11.264)	(0,04 %)

Nicht realisierter Gewinn aus zentral abgerechneten Total Credit Default Swaps	447.604	1,59 %
Nicht realisierter Verlust aus zentral abgerechneten Total Credit Default Swaps	(50.667)	(0,18 %)
Nicht realisierter Nettogewinn aus zentral abgerechneten Total Credit Default Swaps	**396.937**	**1,41 %**

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	Zum 31. Dezember 2023	
	Zeitwert USD	**% des Nettovermögens**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**23.916.660**	**84,93**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(1.532.955)**	**(5,44)**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**22.383.705**	**79,49**
Bankguthaben	5.774.254	20,51
Sonstige Vermögenswerte	97.006	0,34
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(96.349)	(0,34)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**28.158.616**	**100,00**

ZEHN GRÖSSTE BETEILIGUNGEN NACH SEKTOREN ZUM 31. Dezember 2023 IN PROZENT DES NETTOVERMÖGENS

Staatsanleihen	35,72 %
Investmentgesellschaften	2,73 %
Software	2,59 %
Halbleiter	2,51 %
Einzelhandel	2,07 %
Pharmawerte	2,05 %
Elektro	2,01 %
Gesundheit	1,99 %
Banken	1,81 %
Internet	1,79 %

(i) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(ii) Wertpapiere, die nach Rule 144A (i) des U.S. Securities Act aus dem Jahr 1933 nicht registriert werden müssen. Sie können im Rahmen von registrierungsfreien Transaktionen veräußert werden, in der Regel an entsprechend qualifizierte institutionelle Anleger.
* Nicht börsennotierte Wertpapiere.

Sonstige Informationen:
Die zuvor genannten langfristigen Wertpapiere werden, sofern nicht anders angegeben, an geregelten Märkten gehandelt.

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

Abkürzungen:

AUD:	Australischer Dollar
BRL:	Brasilianischer Real
CAD:	Kanadischer Dollar
CHF:	Schweizer Franken
CLP:	Chilenischer Peso
COP:	Kolumbianischer Peso
DKK:	Dänische Krone
EUR:	Euro
GBP:	Britisches Pfund
IDR:	Indonesische Rupiah
ILS:	Israelischer Neuer Schekel
INR:	Indische Rupie
JPY:	Japanischer Yen
KRW:	Koreanischer Won
MXN:	Mexikanischer Peso
MYR:	Malaysischer Ringgit
NOK:	Norwegische Krone
NZD:	Neuseeländischer Dollar
PLN:	Polnischer Zloty
SAR:	Saudi-Arabischer Riyal
SEK:	Schwedische Krone
THB:	Thailändischer Baht
TRY:	Türkische Lira
TWD:	Neuer Taiwan-Dollar
USD:	US-Dollar
UYU:	Uruguayischer Peso
ZAR:	Südafrikanischer Rand

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögen**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind oder an einem geregelten Markt gehandelt werden	52,59
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an offiziellen Börsen notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden.	24,44
Finanzderivate	2,19
Umlaufvermögen	20,78
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 94,61 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 94,69 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 94,61 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 94,69 %)				
Australien - 0,26 % (31. Dezember 2022: 0,27 %)				
CIMIC Finance Ltd, 1,500 %, 28.05.29 EMTN (i)	EUR	100.000	86.315	0,26
			86.315	0,26
Österreich - 1,19 % (31. Dezember 2022: 3,02 %)				
BAWAG Group AG, 6,750 %, 24.02.34 (i) (ii)	EUR	100.000	101.946	0,31
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	186.500	0,57
OMV AG, 6,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	103.395	0,31
			391.841	1,19
Belgien - 0,89 % (31. Dezember 2022: 1,30 %)				
Elia Group SA/NV, 5,850 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	101.625	0,31
KBC Group NV, 0,500 %, 03.12.29 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	95.771	0,29
Syensqo SA, 2,500 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	94.700	0,29
			292.096	0,89
Bermuda - 0,31 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Athora Holding Ltd, 6,625 %, 16.06.28 (i)	EUR	100.000	103.188	0,31
			103.188	0,31
Britische Jungferninseln – 0,59 % (31. Dezember 2022: 0,68 %)				
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000%, 12.12.24 (i)	EUR	200.000	192.604	0,59
			192.604	0,59
Kaimaninseln - 0,32 % (31. Dezember 2022: 0,32 %)				
UPCB Finance VII Ltd, 3,625 %, 15.06.29 (i)	EUR	110.000	104.775	0,32
			104.775	0,32
Tschechische Republik - 0,58 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Allwyn International AS, 3,875 %, 15.02.27 (i)	EUR	200.000	192.000	0,58
			192.000	0,58
Finnland - 2,18 % (31. Dezember 2022: 3,13 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17.09.29 EMTN (i)	EUR	100.000	76.846	0,23
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24.03.25 EMTN (i)	EUR	100.000	96.366	0,29
Citycon OYJ, 3,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	255.000	154.388	0,47
Huhtamaki OYJ, 5,125 %, 24.11.28 (i)	EUR	100.000	104.087	0,32
Kojamo OYJ, 1,500 %, 19.06.24 (i)	EUR	100.000	98.049	0,30
Nordea Bank Abp, 0,625 %, 18.08.31 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	91.848	0,28
Sampo OYJ, 3,375 %, 23.05.49 (i) (ii)	EUR	100.000	94.107	0,29
			715.691	2,18
Frankreich - 21,24 % (31. Dezember 2022: 18,30 %)				
Atos SE, 1,000 %, 12.11.29 (i)	EUR	100.000	53.827	0,16
Atos SE, 1,750 %, 07.05.25 (i)	EUR	100.000	75.986	0,23
Atos SE, 2,500 %, 07.11.28 (i)	EUR	100.000	59.800	0,18
AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	98.750	0,30
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,875 %, 18.06.29 EMTN (i)	EUR	100.000	91.207	0,28
BNP Paribas SA, 2,500 %, 31.03.32 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	189.139	0,58
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27.01.29 (i)	EUR	100.000	88.256	0,27
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18.07.53 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	103.255	0,31
Credit Agricole Assurances SA, 2,625 %, 29.01.48 (i) (ii)	EUR	100.000	92.749	0,28

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Frankreich – 21,24 % (31. Dezember 2022: 18,30 %) (Fortsetzung)				
Credit Agricole SA, 2,625 %, 17.03.27 (i)	EUR	100.000	96.868	0,30
Credit Mutuel Arkea SA, 1,875 %, 25.10.29 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	194.556	0,59
Crown European Holdings SA, 2,875 %, 01.02.26 (i)	EUR	100.000	98.074	0,30
Electricite de France SA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	400.000	354.970	1,08
Electricite de France SA, 2,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	600.000	555.185	1,69
Elis SA, 2,875 %, 15.02.26 EMTN (i)	EUR	100.000	98.238	0,30
ELO SACA, 6,000 %, 22.03.29 EMTN (i)	EUR	100.000	101.427	0,31
Eramet SA, 7,000 %, 22.05.28 (i)	EUR	100.000	101.588	0,31
Eutelsat SA, 1,500 %, 13.10.28 (i)	EUR	100.000	75.000	0,23
Eutelsat SA, 2,250 %, 13.07.27 (i)	EUR	100.000	85.576	0,26
Forvia SE, 2,375 %, 15.06.27 (i)	EUR	145.000	136.858	0,42
Forvia SE, 2,750 %, 15.02.27 (i)	EUR	300.000	286.674	0,87
Forvia SE, 3,125 %, 15.06.26 (i)	EUR	115.000	112.700	0,34
Forvia SE, 7,250 %, 15.06.26 (i)	EUR	200.000	211.750	0,65
Getlink SE, 3,500 %, 30.10.25 (i)	EUR	100.000	98.869	0,30
iliad SA, 2,375 %, 17.06.26 (i)	EUR	400.000	382.080	1,16
La Poste SA, 3,125 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	95.750	0,29
Loxam SAS, 2,875 %, 15.04.26 (i)	EUR	200.000	193.750	0,59
Mutuelle Assurance Des Commercants et Industriels de France et Des Cadres et Sal, 2,125 %, 21.06.52 (i) (ii)	EUR	100.000	76.855	0,23
Nexans SA, 5,500 %, 04.05.28 (i)	EUR	100.000	105.924	0,32
Paprec Holding SA, 3,500 %, 01.07.28 (i)	EUR	155.000	148.800	0,45
Praemia Healthcare SACA, 0,875 %, 04.11.29 (i)	EUR	100.000	82.616	0,25
RCI Banque SA, 2,625 %, 18.02.30 (i) (ii)	EUR	100.000	96.700	0,29
Renault SA, 2,000 %, 28.09.26 EMTN (i)	EUR	300.000	285.889	0,87
Renault SA, 2,375 %, 25.05.26 EMTN (i)	EUR	100.000	96.702	0,30
Renault SA, 2,500 %, 02.06.27 EMTN (i)	EUR	100.000	95.716	0,29
Rexel SA, 5,250 %, 15.09.30 (i)	EUR	200.000	208.332	0,63
Seche Environnement SACA, 2,250 %, 15.11.28 (i)	EUR	100.000	89.816	0,27
SNF Group SACA, 2,625 %, 01.02.29 (i)	EUR	205.000	188.098	0,57
Societe Generale SA, 5,625 %, 02.06.33 EMTN (i)	EUR	100.000	106.577	0,33
Tereos Finance Groupe I SA, 4,750 %, 30.04.27 (i)	EUR	110.000	110.660	0,34
Tereos Finance Groupe I SA, 7,500 %, 30.10.25 (i)	EUR	200.000	203.500	0,62
TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	184.206	0,56
Valeo SE, 1,000 %, 03.08.28 EMTN (i)	EUR	300.000	262.864	0,80
Valeo SE, 1,500 %, 18.06.25 EMTN (i)	EUR	200.000	193.180	0,59
Vallourec SACA, 8,500 %, 30.06.26 (i)	EUR	310.000	311.511	0,95
			6.980.828	21,24
Deutschland - 7,52 % (31. Dezember 2022: 10,64 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07.09.38 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	102.386	0,31
Bayer AG, 3,125 %, 12.11.79 (i) (ii)	EUR	300.000	270.389	0,82
Bayer AG, 5,375 %, 25.03.82 (i) (ii)	EUR	200.000	189.823	0,58
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23.04.75 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	190.520	0,58
Commerzbank AG, 1,375 %, 29.12.31 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	89.404	0,27
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16.05.27 EMTN (i)	EUR	300.000	288.174	0,88
Evonik Industries AG, 1,375 %, 02.09.81 (i) (ii)	EUR	100.000	88.367	0,27
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01.11.24 EMTN (i)	EUR	100.000	96.558	0,29
IHO Verwaltungs GmbH, 3,875 %, 15.05.27 (i)	EUR	100.000	97.680	0,30

Vermögensaufstellung			**Zum 31. Dezember 2023**	
		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Deutschland – 7,52 % (31. Dezember 2022: 10,64 %) (Fortsetzung)				
IHO Verwaltungs GmbH, 8,750 %, 15.05.28 (i)	EUR	100.000	108.743	0,33
Infineon Technologies AG, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	97.500	0,30
Mahle GmbH, 2,375 %, 14.05.28 EMTN (i)	EUR	100.000	85.122	0,26
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, 15.04.29 EMTN (i)	EUR	100.000	94.301	0,29
Schaeffler AG, 3,375 %, 12.10.28 EMTN (i)	EUR	100.000	96.750	0,29
Talanx AG, 2,250 %, 05.12.47 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	93.230	0,28
thyssenkrupp AG, 2,875 %, 22.02.24 EMTN (i)	EUR	300.000	298.686	0,91
ZF Finance GmbH, 2,000 %, 06.05.27 EMTN (i)	EUR	100.000	92.273	0,28
ZF Finance GmbH, 2,250 %, 03.05.28 EMTN (i)	EUR	100.000	91.625	0,28
			2.471.531	7,52
Gibraltar - 0,29 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, 15.07.27 (i)	EUR	100.000	95.750	0,29
			95.750	0,29
Irland - 2,12 % (31. Dezember 2022: 1,34 %)				
AIB Group PLC, 1,875 %, 19.11.29 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	194.366	0,59
Energia Group Roi Financeco DAC, 6,875 %, 31.07.28 (i)	EUR	200.000	207.071	0,63
James Hardie International Finance DAC, 3,625 %, 01.10.26 (i)	EUR	300.000	295.560	0,90
			696.997	2,12
Isle of Man - 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,14 %)				
Playtech PLC, 4,250 %, 07.03.26 (i)	EUR	100.000	97.678	0,30
			97.678	0,30
Italien - 7,15 % (31. Dezember 2022: 6,75 %)				
Amplifon SpA, 1,125 %, 13.02.27 (i)	EUR	200.000	184.034	0,56
Assicurazioni Generali SpA 5,800 %, 06.07.32 EMTN (i)	EUR	200.000	214.856	0,65
Azzurra Aeroporti SpA, 2,625 %, 30.05.27 (i)	EUR	200.000	186.192	0,57
Enel SpA, 1,375 %, (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	87.240	0,27
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA, 5,500 %, 17.05.27 (i) (iv)	EUR	100.000	90.000	0,27
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,625 %, 21.10.28 (i)	EUR	100.000	92.392	0,28
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,750 %, 19.04.31 (i)	EUR	120.000	107.304	0,33
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08.07.26 (i)	EUR	200.000	192.139	0,58
Lottomatica SpA, 9,750 %, 30.09.27 (i)	EUR	100.000	108.150	0,33
Mundys SpA, 1,875 %, 12.02.28 (i)	EUR	220.000	202.159	0,62
Piaggio & C SpA, 6,500 %, 05.10.30 (i)	EUR	200.000	210.995	0,64
Poste Italiane SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	330.000	270.993	0,82
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 2,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	210.000	187.649	0,57
Webuild SpA, 3,625 %, 28.01.27 (i)	EUR	230.000	217.700	0,66
			2.351.803	7,15
Luxemburg - 3,82 % (31. Dezember 2022: 3,01 %)				
Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	70.119	0,21
Bevco Lux Sarl, 1,000 %, 16.01.30 (i)	EUR	100.000	83.517	0,26
CPI Property Group SA, 1,750 %, 14.01.30 EMTN (i)	EUR	100.000	56.517	0,17
CPI Property Group SA, 4,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	235.000	68.647	0,21
Dana Financing Luxembourg Sarl, 3,000 %, 15.07.29 (i)	EUR	100.000	88.150	0,27
Euroclear Investments SA, 2,625 %, 11.04.48 (i) (ii)	EUR	100.000	92.520	0,28
Eurofins Scientific SE, 3,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	95.952	0,29
Eurofins Scientific SE, 6,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	207.873	0,63
SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	225.000	224.658	0,69
Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl, 3,500 %, 01.03.28 (i)	EUR	200.000	190.340	0,58

Vermögensaufstellung				**Zum 31. Dezember 2023**
		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Luxemburg – 3,82 % (31. Dezember 2022: 3,01 %) (Fortsetzung)				
Vivion Investments Sarl, 7,900 %, 28.02.29 EMTN (i)	EUR	100.000	76.000	0,23
			1.254.293	3,82
Mexiko - 0,30 % (31. Dezember 2022: 0,35 %)				
Cemex SAB de CV, 3,125 %, 19.03.26 (i)	EUR	100.000	97.830	0,30
			97.830	0,30
Niederlande - 17,49 % (31. Dezember 2022: 17,07 %)				
Abertis Infraestructuras Finance BV, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	400.000	363.960	1,11
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22.02.33 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	102.829	0,31
Achmea BV, 2,500 %, 24.09.39 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	86.085	0,26
ASR Nederland NV, 3,375 %, 02.05.49 (i) (ii)	EUR	200.000	185.428	0,56
Boels Topholding BV, 6,250 %, 15.02.29 (i)	EUR	100.000	104.343	0,32
Citycon Treasury BV, 1,625 %, 12.03.28 EMTN (i)	EUR	100.000	79.730	0,24
de Volksbank NV, 1,750 %, 22.10.30 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	94.068	0,29
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	170.000	166.413	0,51
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29.09.47 (i) (ii)	EUR	100.000	95.243	0,29
ELM BV for Swiss Life Insurance & Pension Group, 4,500 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	198.000	0,60
ING Groep NV, 1,625 %, 26.09.29 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	97.483	0,30
ING Groep NV, 2,125 %, 26.05.31 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	95.356	0,29
Koninklijke FrieslandCampina NV, 2,850 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	91.750	0,28
NN Group NV, 4,625 %, 13.01.48 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	100.250	0,30
NN Group NV, 5,250 %, 03.01.43 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	102.077	0,31
OI European Group BV, 6,250 %, 15.05.28 (i)	EUR	115.000	120.398	0,37
PPF Telecom Group BV, 2,125 %, 31.01.25 EMTN (i)	EUR	200.000	195.527	0,59
PPF Telecom Group BV, 3,250 %, 29.09.27 EMTN (i)	EUR	100.000	96.972	0,29
Saipem Finance International BV, 3,375 %, 15.07.26 EMTN (i)	EUR	200.000	194.718	0,59
Telefonica Europe BV, 2,376 % (i) (ii) (iii)	EUR	300.000	260.288	0,79
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	800.000	773.432	2,35
TenneT Holding BV, 2,374 % (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	193.758	0,59
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, 15.10.24 (i)	EUR	100.000	97.000	0,30
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,625 %, 15.10.28 (i)	EUR	370.000	314.485	0,96
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,875 %, 31.03.27 (i)	EUR	350.000	317.625	0,97
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,375 %, 09.05.30 (i)	EUR	200.000	187.364	0,57
Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)	EUR	400.000	362.000	1,10
ZF Europe Finance BV, 2,000 %, 23.02.26 (i)	EUR	400.000	381.000	1,16
ZF Europe Finance BV, 2,500 %, 23.10.27 (i)	EUR	200.000	186.750	0,57
ZF Finance BV, 6,125 %, 13.03.29 EMTN (i)	EUR	100.000	106.154	0,32
			5.750.486	17,49
Norwegen - 0,95 % (31. Dezember 2022: 0,68 %)				
Adevinta ASA, 3,000 %, 15.11.27 (i)	EUR	100.000	99.405	0,30
Var Energi ASA, 7,862 %, 15.11.83 (i) (ii)	EUR	200.000	212.706	0,65
			312.111	0,95

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Portugal - 1,74 % (31. Dezember 2022: 1,63 %)				
EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20.07.80 (i) (ii)	EUR	600.000	572.916	1,74
			572.916	1,74
Spanien - 6,14 % (31. Dezember 2022: 5,05 %)				
ACS Actividades de Construccion y Servicios SA, 1,375 %, 17.06.25 EMTN (i)	EUR	100.000	96.560	0,29
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, 02.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	103.214	0,32
Banco Santander SA, 5,750 %, 23.08.33 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	209.733	0,64
CaixaBank SA, 6,250 %, 23.02.33 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	105.472	0,32
Cellnex Finance Co S.A., 0,750 %, 15.11.26 EMTN (i)	EUR	100.000	92.533	0,28
Cellnex Finance Co S.A., 1,250 %, 15.01.29 EMTN (i)	EUR	200.000	178.600	0,54
Cellnex Finance Co S,A,, 2,250 %, 12.04.26 EMTN (i)	EUR	100.000	97.034	0,30
Cellnex Telecom SA, 1,875 %, 26.06.29 (i)	EUR	600.000	546.877	1,66
Food Service Project SA, 5,500%, 21.01.27 (i)	EUR	100.000	99.673	0,30
Grifols SA, 2,250 %, 15.11.27 (i)	EUR	100.000	93.945	0,29
International Consolidated Airlines Group SA, 3,750 %, 25.03.29 (i)	EUR	200.000	193.500	0,59
Mapfre SA, 4,125 %, 07.09.48 (i) (ii)	EUR	100.000	96.429	0,29
Unicaja Banco SA, 6,500 %, 11.09.28 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	103.804	0,32
			2.017.374	6,14
Superanationale Anleihen - 0,54 % (31. Dezember 2022: 0,61 %)				
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA Inc, 2,125 %, 15.08.26 (i)	EUR	200.000	177.827	0,54
			177.827	0,54
Schweden - 1,28 % (31. Dezember 2022: 2,40 %)				
Castellum AB, 3,125 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	75.971	0,23
Dometic Group AB, 2,000 %, 29.09.28 EMTN (i)	EUR	100.000	87.000	0,26
Heimstaden AB, 4,250 %, 09.03.26 (i)	EUR	100.000	46.605	0,14
Heimstaden Bostad AB, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	105.000	35.228	0,11
Heimstaden Bostad AB, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	82.000	0,25
Volvo Car AB, 2,500 %, 07.10.27 EMTN (i)	EUR	100.000	94.500	0,29
			421.304	1,28
Vereinigtes Königreich - 9,17 % (31. Dezember 2022: 8,11 %)				
BP Capital Markets PLC, 3,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	96.500	0,29
DS Smith PLC, 4,500 %, 27.07.30 EMTN (i)	EUR	100.000	104.121	0,32
INEOS Quattro Finance 2 PLC, 8,500 %, 15.03.29 (i)	EUR	200.000	210.764	0,64
International Distributions Services PLC, 5,250 %, 14.09.28 (i)	EUR	100.000	103.811	0,32
International Game Technology PLC, 2,375 %, 15.04.28 (i)	EUR	215.000	199.412	0,61
International Game Technology PLC, 3,500 %, 15.06.26 (i)	EUR	100.000	99.199	0,30
Jaguar Land Rover Automotive PLC, 2,200 %, 15.01.24 (i)	EUR	100.000	99.730	0,30
Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4,500 %, 15.07.28 (i)	EUR	300.000	292.500	0,89
Lloyds Banking Group PLC, 4,500 %, 18.03.30 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	99.786	0,30
Nationwide Building Society, 2,000 %, 25.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	196.060	0,60
NGG Finance PLC, 2,125 %, 05.09.82 (i) (ii)	EUR	200.000	181.222	0,55
Nomad Foods Bondco PLC, 2,500 %, 24.06.28 (i)	EUR	100.000	93.910	0,29
PEU Fin PLC, 7,250 %, 01.07.28 (i)	EUR	200.000	205.740	0,63
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	181.180	0,55
Vmed O2 UK Financing I PLC, 3,250 %, 31.01.31 (i)	EUR	190.000	174.325	0,53
Vodafone Group PLC, 2,625 %, 27.08.80 (i) (ii)	EUR	495.000	470.096	1,43

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich – 9,17 % (31. Dezember 2022: 8,11 %) (Fortsetzung)				
Vodafone Group PLC, 3,000 %, 27.08.80 (i) (ii)	EUR	230.000	205.604	0,62
			3.013.960	9,17
Vereinigte Staaten - 8,25 % (31. Dezember 2022: 9,56 %)				
Avantor Funding Inc, 2,625 %, 01.11.25	EUR	200.000	195.352	0,59
Ball Corp, 1,500 %, 15.03.27	EUR	100.000	93.555	0,28
Belden Inc, 3,375 %, 15.07.31	EUR	100.000	88.135	0,27
Coty Inc, 3,875 %, 15.04.26	EUR	225.000	224.124	0,68
Coty Inc, 5,750 %, 15.09.28	EUR	100.000	105.318	0,32
Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,375 %, 15.12.30 *	EUR	100.000	106.881	0,32
Ford Motor Credit Co LLC, 2,330 %, 25.11.25	EUR	200.000	193.997	0,59
Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15.09.25 EMTN	EUR	100.000	98.642	0,30
Graphic Packaging International LLC, 2,625 %, 01.02.29	EUR	100.000	92.095	0,28
IQVIA Inc, 2,250 %, 15.01.28	EUR	400.000	375.000	1,14
IQVIA Inc, 2,875 %, 15.06.28	EUR	100.000	95.131	0,29
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, 0,993 %, 15.10.26	EUR	110.000	82.434	0,25
Organon & Co/Organon Foreign Debt Co-Issuer BV, 2,875 %, 30.04.28	EUR	300.000	275.161	0,84
Silgan Holdings Inc, 3,250 %, 15.03.25	EUR	100.000	99.001	0,30
Standard Industries Inc, 2,250 %, 21.11.26	EUR	100.000	94.250	0,29
Tapestry Inc, 5,875 %, 27.11.31	EUR	100.000	105.166	0,32
UGI International LLC, 2,500 %, 01.12.29	EUR	130.000	110.191	0,34
WMG Acquisition Corp, 2,250 %, 15.08.31	EUR	315.000	275.625	0,84
			2.710.058	8,24
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**31.101.256**	**94,61**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**31.101.256**	**94,61**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: EUR 30.447.641)			**31.101.256**	**94,61**

FINANZDERIVATE – 0,04 % (31. Dezember 2022: (0,09 %))

Offene Devisenterminkontrakte – 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Fälligkeits-datum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	CHF 60	EUR 64	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – 0,00 % (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
1/31/24	CHF 61	EUR 65	Brown Brothers Harriman	1	0,00 %
1/31/24	CHF 2.906	EUR 3.086	Brown Brothers Harriman	45	0,00 %
1/31/24	CHF 2.911	EUR 3.092	Brown Brothers Harriman	46	0,00 %
1/31/24	CHF 2.926	EUR 3.107	Brown Brothers Harriman	46	0,00 %
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				139	0,00 %
Nicht realisierter Nettogewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				**139**	**0,00 %**

Futures - 0,04 % (31. Dezember 2022: (0,09 %))

Anzahl Kontrakte	**Beschreibung**	**Kontrahent**	**Engagement**	**Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)**	**% des Nettovermögens**
2	Euro-Bund March 2024 Futures	JP Morgan	265.940	8.500	0,03 %
15	Euro-Schatz March 2024 Futures	JP Morgan	1.593.000	5.175	0,01 %
Nicht realisierter Gewinn aus Futures				13.675	0,04 %
Nicht realisierter Nettogewinn auf Futures				**13.675**	**0,04 %**

	Zeitwert EUR	**% des Nettovermögens**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**31.115.070**	**94,65**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**31.115.070**	**94,65**
Bankguthaben	1.367.976	4,16
Sonstige Vermögenswerte	494.862	1,51
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(103.489)	(0,32)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**32.874.419**	**100,00**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

ZEHN GRÖSSTE BETEILIGUNGEN NACH SEKTOREN ZUM 31. Dezember 2023 IN PROZENT DES NETTOVERMÖGENS

Autos	11,84 %
Banken	8,28 %
Telekommunikation	7,79 %
Elektro	7,43 %
Bau- und Ingenieurswesen	7,19 %
Versicherung	5,87 %
Pharmawerte	5,87 %
Real Estate	3,39 %
Entertainment	3,25 %
Gesundheit	2,95 %

(i) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(ii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(iii) Ewige Anleihen.
(iv) Stufenzinsanleihe. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
* Nicht börsennotierte Wertpapiere.

Sonstige Informationen:
Die zuvor genannten langfristigen Wertpapiere werden, sofern nicht anders angegeben, an geregelten Märkten gehandelt.

Abkürzungen:

CHF:	Schweizer Franken
EUR:	Euro

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögens**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	93,71
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	0,04
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die nicht an offiziellen Börsen notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden.	0,60
Finanzderivate	0,00
Umlaufvermögen	5,65
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 97,23 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,92 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 97,23 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,92 %)				
Australien - 0,63 % (31. Dezember 2022: 0,10 %)				
APA Infrastructure Ltd, 1,250 %, 15.03.33 EMTN (i)	EUR	350.000	282.086	0,22
National Australia Bank Ltd, 1,375 %, 30.08.28 EMTN (i)	EUR	550.000	508.279	0,41
			790.365	0,63
Österreich - 1,27 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)				
BAWAG PSK Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse AG, 4,125 %, 18.01.27 EMTN (i)	EUR	300.000	303.963	0,24
Erste Group Bank AG, 0,250 %, 14.09.29 EMTN (i)	EUR	300.000	252.811	0,20
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	373.000	0,30
Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30.05.30 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	311.462	0,25
Raiffeisen Bank International AG, 0,050 %, 01.09.27 EMTN (ii)	EUR	400.000	348.673	0,28
			1.589.909	1,27
Belgien - 3,26 % (31. Dezember 2022: 3,28 %)				
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 1,650 %, 28.03.31 EMTN (i)	EUR	120.000	110.060	0,09
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, 02.04.40 EMTN (i)	EUR	400.000	408.712	0,33
Belfius Bank SA, 3,875 %, 12.06.28 EMTN (i)	EUR	300.000	307.051	0,25
Belfius Bank SA, 4,125 %, 12.09.29 EMTN (i)	EUR	200.000	207.054	0,17
Elia Transmission Belgium SA, 0,875 %, 28.04.30 EMTN (i)	EUR	300.000	261.495	0,21
Euroclear Bank SA, 3,625 %, 13.10.27 EMTN (i)	EUR	505.000	514.927	0,41
FLUVIUS System Operator CVBA, 0,250 %, 14.06.28 EMTN (i)	EUR	300.000	265.338	0,21
FLUVIUS System Operator CVBA, 3,875 %, 18.03.31 EMTN (i)	EUR	400.000	414.526	0,33
KBC Group NV, 0,750 %, 21.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	367.864	0,29
KBC Group NV, 1,625 %, 18.09.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	292.280	0,23
KBC Group NV, 4,250 %, 28.11.29 EMTN (i) (ii)	EUR	500.000	513.765	0,41
Lonza Finance International NV, 1,625 %, 21.04.27 (i)	EUR	150.000	143.707	0,12
Lonza Finance International NV, 3,875 %, 25.05.33 (i)	EUR	255.000	264.856	0,21
			4.071.635	3,26
Bermuda - 0,14 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Athora Holding Ltd, 6,625 %, 16.06.28 (i)	EUR	170.000	175.420	0,14
			175.420	0,14
Britische Jungferninseln – 0,23 % (31. Dezember 2022: 0,27 %)				
Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd, 1,000%, 12.12.24 (i)	EUR	300.000	288.906	0,23
			288.906	0,23
Kanada - 0,98 % (31. Dezember 2022: 1,46 %)				
Great-West Lifeco Inc, 4,700 %, 16.11.29	EUR	220.000	235.779	0,19
Magna International Inc, 4,375 %, 17.03.32	EUR	285.000	303.915	0,24
Mercedes-Benz Finance Canada Inc, 3,000%, 23.02.27 EMTN	EUR	680.000	680.537	0,55
			1.220.231	0,98
Kaimaninseln - 0,29 % (31. Dezember 2022: 0,28 %)				
CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 2,000 %, 13.04.30 (i)	EUR	400.000	362.395	0,29
			362.395	0,29
Dänemark - 1,48 % (31. Dezember 2022: 1,05 %)				
Carlsberg Breweries AS, 0,375 %, 30.06.27 (i)	EUR	320.000	291.789	0,23
Jyske Bank A/S, 0,250 %, 17.02.28 EMTN (i) (ii)	EUR	275.000	249.505	0,20
Nykredit Realkredit AS, 4,625 %, 19.01.29 EMTN (i)	EUR	300.000	309.906	0,25
Orsted AS, 1,500 %, 26.11.29 (i)	EUR	820.000	741.634	0,60
Pandora A/S, 4,500 %, 10.04.28 EMTN (i)	EUR	240.000	248.824	0,20
			1.841.658	1,48

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Finnland - 2,21 % (31. Dezember 2022: 0,28 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17.09.29 EMTN (i)	EUR	295.000	226.696	0,18
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24.03.25 EMTN (i)	EUR	100.000	96.366	0,08
Fortum OYJ, 4,500 %, 26.05.33 EMTN (i)	EUR	270.000	286.500	0,23
Kojamo OYJ, 1,500 %, 19.06.24 (i)	EUR	250.000	245.121	0,20
Neste OYJ, 3,875 %, 21.05.31 EMTN (i)	EUR	320.000	332.132	0,27
Nordea Bank Abp, 0,625 %, 18.08.31 EMTN (i) (ii)	EUR	475.000	436.279	0,35
Nordea Bank Abp, 1,125 %, 16.02.27 EMTN (i)	EUR	420.000	394.267	0,32
OP Corporate Bank PLC, 1,625 %, 09.06.30 (i) (ii)	EUR	140.000	133.742	0,11
Sampo OYJ, 3,375 %, 23.05.49 (i) (ii)	EUR	100.000	94.106	0,07
Teollisuuden Voima OYJ, 2,625 %, 31.03.27 EMTN (i)	EUR	200.000	192.727	0,15
Teollisuuden Voima OYJ, 4,750 %, 01.06.30 EMTN (i)	EUR	300.000	313.920	0,25
			2.751.856	2,21
Frankreich - 17,06 % (31. Dezember 2022: 14,54 %)				
ALD SA, 1,250 %, 02.03.26 EMTN (i)	EUR	200.000	190.832	0,15
ALD SA, 4,250 %, 18.01.27 EMTN (i)	EUR	300.000	306.643	0,25
ALD SA, 4.375 %, 23.11.26 (i)	EUR	400.000	409.606	0,33
Alstom SA, 0,125 %, 27.07.27 (i)	EUR	100.000	87.648	0,07
APRR SA, 1,500 %, 25.01.30 EMTN (i)	EUR	300.000	276.278	0,22
APRR SA, 3,125 %, 24.01.30 EMTN (i)	EUR	100.000	100.810	0,08
Arval Service Lease SA, 4,125 %, 13.04.26 EMTN (i)	EUR	300.000	303.495	0,24
Autoroutes du Sud de la France SA, 1,250 %, 18.01.27 EMTN (i)	EUR	400.000	381.680	0,31
AXA SA, 1,875 %, 10.07.42 EMTN (i) (ii)	EUR	290.000	238.726	0,19
AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	197.500	0,16
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,250 %, 29.06.28 EMTN (i)	EUR	100.000	87.990	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,625 %, 03.11.28 EMTN (i)	EUR	400.000	349.716	0,28
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,250 %, 26.05.27 EMTN (i)	EUR	100.000	93.725	0,07
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,875 %, 18.06.29 EMTN (i)	EUR	300.000	273.622	0,22
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3,125 %, 14.09.27 EMTN (i)	EUR	400.000	398.762	0,32
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4,125 %, 14.06.28 EMTN (i)	EUR	400.000	419.886	0,34
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4,750 %, 10.11.31 EMTN (i)	EUR	300.000	318.469	0,25
Banque Stellantis France SACA, 3,875 %, 19.01.26 EMTN (i)	EUR	400.000	402.750	0,32
BNP Paribas SA, 0,250 %, 13.04.27 EMTN (i) (ii)	EUR	800.000	742.547	0,59
BNP Paribas SA, 1,125 %, 17.04.29 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	360.900	0,29
BNP Paribas SA, 2,500 %, 31.03.32 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	283.708	0,23
BNP Paribas SA, 3,625 % 01.09.29 EMTN (i)	EUR	400.000	401.556	0,32
BNP Paribas SA, 3,875 %, 23.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	408.902	0,33
Carrefour SA, 4,375 %, 14.11.31 EMTN (i)	EUR	200.000	211.950	0,17
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27.01.29 (i)	EUR	100.000	88.256	0,07
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18.07.53 EMTN (i) (ii)	EUR	100.000	103.255	0,08
Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 0,875 %, 29.09.24 (i)	EUR	300.000	293.100	0,23
Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 2,125 %, 29.07.32 (i)	EUR	300.000	271.525	0,22

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Frankreich – 17,06 % (31. Dezember 2022: 14,54 %) (Fortsetzung)				
Covivio SA, 4,625 %, 05.06.32 EMTN (i)	EUR	300.000	311.043	0,25
Credit Agricole Assurances SA, 2,625 %, 29.01.48 (i) (ii)	EUR	200.000	185.498	0,15
Credit Agricole Assurances SA, 4,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	99.380	0,08
Credit Agricole SA, 1,875 %, 22.04.27 (i) (ii)	EUR	800.000	771.280	0,62
Credit Agricole SA, 2,625 %, 17.03.27 (i)	EUR	175.000	169.519	0,14
Credit Agricole SA, 3,375 %, 28.07.27 EMTN (i)	EUR	400.000	402.558	0,32
Credit Agricole SA, 4,250 %, 11.07.29 (i) (ii)	EUR	300.000	309.624	0,25
Credit Mutuel Arkea SA, 3,375 %, 19.09.27 EMTN (i)	EUR	300.000	300.940	0,24
Danone SA, 3,470 %, 22.05.31 EMTN (i)	EUR	300.000	308.104	0,25
Electricite de France SA, 2,000 %, 09.12.49 EMTN (i)	EUR	300.000	198.885	0,16
Electricite de France SA, 3,750 %, 05.06.27 EMTN (i)	EUR	300.000	305.848	0,24
ELO SACA, 6,000 %, 22.03.29 EMTN (i)	EUR	300.000	304.282	0,24
Engie SA, 1,500 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	88.019	0,07
Engie SA, 4,000 %, 11.01.35 EMTN (i)	EUR	200.000	207.866	0,17
Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30.04.30 (i)	EUR	245.000	226.909	0,18
Banque Federative du Credit Mutuel SADIR, 1,850 %, 21.04.42 (i) (ii)	EUR	100.000	80.698	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,475 %, 18.01.31 EMTN (i)	EUR	300.000	256.950	0,21
HSBC Continental Europe SA, 1,375 %, 04.09.28 EMTN (i)	EUR	400.000	368.587	0,30
Klepierre SA, 0,625 %, 01.07.30 EMTN (i)	EUR	300.000	249.446	0,20
La Poste SA, 0,375 %, 17.09.27 EMTN (i)	EUR	300.000	272.911	0,22
Legrand SA, 3,500 %, 29.05.29 (i)	EUR	200.000	206.594	0,17
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,250 %, 07.09.29 EMTN (i)	EUR	600.000	610.979	0,49
Orange SA, 5,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	209.106	0,17
Orano SA, 5,375 %, 15.05.27 EMTN (i)	EUR	100.000	104.595	0,08
Praemia Healthcare SACA, 0,875 %, 04.11.29 (i)	EUR	300.000	247.850	0,20
Praemia Healthcare SACA, 5,500 %, 19.09.28 (i)	EUR	200.000	209.368	0,17
RCI Banque SA, 4,500 %, 06.04.27 EMTN (i)	EUR	225.000	231.120	0,18
RCI Banque SA, 4,625 %, 02.10.26 EMTN (i)	EUR	305.000	313.075	0,25
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 3,750 %, 04.07.35 EMTN (i)	EUR	300.000	313.352	0,25
Sanofi SA, 1,250 %, 06.04.29 (i)	EUR	400.000	371.997	0,30
Sanofi SA, 1,375 %, 21.03.30 EMTN (i)	EUR	300.000	276.796	0,22
Societe Generale SA, 0,125 %, 17.11.26 (i) (ii)	EUR	500.000	469.477	0,38
Societe Generale SA, 0,500 %, 12.06.29 (i) (ii)	EUR	300.000	259.990	0,21
Societe Generale SA, 0,625 %, 02.12.27 (i) (ii)	EUR	600.000	549.805	0,44
Societe Generale SA, 4,125 %, 02.06.27 (i)	EUR	200.000	205.076	0,16
Societe Generale SA, 4,125 %, 21.11.28 EMTN (i)	EUR	300.000	310.810	0,25
Societe Generale SA, 5,625 %, 02.06.33 EMTN (i)	EUR	200.000	213.154	0,17
Suez SACA, 2,375 %, 24.05.30 EMTN (i)	EUR	300.000	282.705	0,23
Thales SA, 4,250 %, 18.10.31 EMTN (i)	EUR	300.000	318.497	0,25
TotalEnergies Capital International SA, 0,696 %, 31.05.28 EMTN (i)	EUR	400.000	364.146	0,29
TotalEnergies Capital International SA, 1,618 %, 18.05.40 EMTN (i)	EUR	200.000	156.987	0,13
TotalEnergies SE, 1,750 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	210.000	207.756	0,17
TotalEnergies SE, 2,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	700.000	644.720	0,52
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,625 %, 04.05.27 EMTN (i)	EUR	300.000	274.084	0,22

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Frankreich – 17,06 % (31. Dezember 2022: 14,54 %) (Fortsetzung)				
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,875 %, 29.03.32 EMTN (i)	EUR	100.000	79.903	0,06
Verallia SA, 1,875 %, 10.11.31 (i)	EUR	300.000	263.254	0,21
WPP Finance SA, 4,125 %, 30.05.28 EMTN (i)	EUR	170.000	175.429	0,14
			21.292.809	17,06
Deutschland - 9,75 % (31. Dezember 2022: 8,27 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07.09.38 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	307.159	0,25
Allianz SE, 5,824 %, 25.07.53 (i) (ii)	EUR	100.000	109.527	0,09
Amprion GmbH, 0,625 %, 23.09.33 EMTN (i)	EUR	200.000	154.758	0,12
BASF SE, 4,500 %, 08.03.35 EMTN (i)	EUR	300.000	325.957	0,26
Bayer AG, 4,250 %, 26.08.29 EMTN (i)	EUR	300.000	310.674	0,25
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15.02.25 (i)	EUR	345.000	335.951	0,27
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15.08.24 (i)	EUR	480.000	472.933	0,38
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04.01.37 (i)	EUR	1.675.000	2.015.383	1,61
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15.02.32 (i)	EUR	700.000	598.772	0,48
Commerzbank AG, 3,000 %, 14.09.27 (i) (ii)	EUR	300.000	293.759	0,23
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03.03.34 EMTN (i)	EUR	465.000	398.100	0,32
Deutsche Bahn Finance GmbH, 4,000 %, 23.11.43 EMTN (i)	EUR	100.000	109.247	0,09
Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03.09.26 EMTN (i) (ii)	EUR	500.000	478.743	0,38
Deutsche Bank AG, 1,750 %, 19.11.30 EMTN (i) (ii)	EUR	600.000	521.079	0,42
Deutsche Börse AG, 3,750 %, 28.09.29 (i)	EUR	900.000	936.370	0,75
Deutsche Börse AG, 3,875 %, 28.09.26 (i)	EUR	300.000	306.632	0,25
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16.05.27 EMTN (i)	EUR	200.000	192.116	0,15
Deutsche Telekom AG, 3,375 %, 03.07.33 EMTN (i)	EUR	275.000	280.640	0,22
Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	98.199	0,08
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01.11.24 EMTN (i)	EUR	400.000	386.232	0,31
Infineon Technologies AG, 1,625 %, 24.06.29 EMTN (i)	EUR	500.000	463.078	0,37
Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21.09.27 EMTN (i)	EUR	400.000	403.077	0,32
LANXESS AG, 0,625 %, 01.12.29 EMTN (i)	EUR	200.000	162.653	0,13
Merck Financial Services GmbH, 0,500 %, 16.07.28 EMTN (i)	EUR	300.000	269.675	0,22
Merck KGaA, 1,625 %, 09.09.80 (i) (ii)	EUR	200.000	185.264	0,15
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26.05.49 (i) (ii)	EUR	100.000	96.750	0,08
Robert Bosch GmbH, 4,375 %, 02.06.43 EMTN (i)	EUR	300.000	321.616	0,26
Talanx AG, 4,000 %, 25.10.29 EMTN (i)	EUR	300.000	312.320	0,25
Volkswagen Bank GmbH, 2,500 %, 31.07.26 EMTN (i)	EUR	500.000	486.937	0,39
Volkswagen Bank GmbH, 4,375 %, 03.05.28 EMTN (i)	EUR	400.000	412.216	0,33
Volkswagen Bank GmbH, 4,625 %, 03.05.31 EMTN (i)	EUR	400.000	419.310	0,34
			12.165.127	9,75
Irland - 2,54 % (31. Dezember 2022: 2,82 %)				
Abbott Ireland Financing DAC, 1,500 %, 27.09.26 (i)	EUR	300.000	289.410	0,23
AIB Group PLC, 1,875 %, 19.11.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	291.549	0,23
AIB Group PLC, 5,750 %, 16.02.29 (i) (ii)	EUR	350.000	376.143	0,30
Bank of Ireland Group PLC, 1,875 %, 05.06.26 EMTN (i) (ii)	EUR	250.000	243.105	0,20
CCEP Finance Ireland DAC, Zero Coupon Bond, 06.09.25 (i)	EUR	420.000	397.082	0,32
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, 11.07.27 EMTN (i)	EUR	300.000	308.132	0,25
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, 11.07.31 EMTN (i)	EUR	365.000	379.096	0,30
Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12.10.26 (i)	EUR	260.000	247.259	0,20
Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25.04.28 (i) (ii)	EUR	300.000	316.404	0,25

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Irland - 2,54 % (31. Dezember 2022: 2,82 %) (Fortsetzung)				
Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2,875 %, 15.01.26 (i)	EUR	330.000	324.918	0,26
			3.173.098	2,54
Italien - 2,38 % (31. Dezember 2022: 2,17 %)				
Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, 15.01.30 (i)	EUR	400.000	354.352	0,28
Enel SpA, 1,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	275.000	239.910	0,19
ENI SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	255.000	244.481	0,19
Hera SpA, 0,250 %, 03.12.30 EMTN (i)	EUR	400.000	321.414	0,26
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08.07.26 (i)	EUR	310.000	297.816	0,24
Intesa Sanpaolo SpA, 2,125 %, 26.05.25 EMTN (i)	EUR	250.000	244.922	0,20
Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19.05.26 EMTN (i)	EUR	320.000	324.557	0,26
Intesa Sanpaolo SpA, 4,875 %, 19.05.30 EMTN (i)	EUR	380.000	399.543	0,32
Intesa Sanpaolo SpA, 5.000 %, 08.03.28 EMTN (i) (ii)	EUR	385.000	398.207	0,32
Snam SpA, 0,750 %, 17.06.30 EMTN (i)	EUR	175.000	148.567	0,12
			2.973.769	2,38
Japan - 0,55 % (31. Dezember 2022: 0,23 %)				
Asahi Group Holdings Ltd, 0,541 %, 23.10.28 (i)	EUR	380.000	335.361	0,27
Takeda Pharmaceutical Co Ltd., 3,000 %, 21.11.30 (i)	EUR	350.000	345.057	0,28
			680.418	0,55
Jersey, Kanalinseln - 0,34 % (31. Dezember 2022: 0,59 %)				
Heathrow Funding Ltd, 1,125 %, 08.10.30 EMTN (i)	EUR	355.000	303.549	0,24
Heathrow Funding Ltd, 1,875 %, 12.07.32 EMTN (i)	EUR	135.000	118.077	0,10
			421.626	0,34
Luxemburg - 4,39 % (31. Dezember 2022: 7,92 %)				
Aroundtown SA, 1,450 %, 09.07.28 EMTN (i)	EUR	200.000	155.632	0,12
Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	35.060	0,03
Aroundtown SA, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	40.405	0,03
Becton Dickinson Euro Finance Sarl, 0,334 %, 13.08.28 (i)	EUR	300.000	264.158	0,21
Bevco Lux Sarl, 1,000 %, 16.01.30 (i)	EUR	370.000	309.011	0,25
CK Hutchison Group Telecom Finance SA, 0,750 %, 17.04.26 (i)	EUR	310.000	291.815	0,23
CNH Industrial Finance Europe SA, 1,875 %, 19.01.26 EMTN (i)	EUR	265.000	257.227	0,21
CPI Property Group SA, 1,750 %, 14.01.30 EMTN (i)	EUR	175.000	98.905	0,08
DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18.03.28 (i)	EUR	190.000	171.644	0,14
Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07.12.26 (i)	EUR	300.000	285.252	0,23
Euroclear Investments SA, 2,625 %, 11.04.48 (i) (ii)	EUR	200.000	185.040	0,15
Eurofins Scientific SE, 0,875 %, 19.05.31 (i)	EUR	300.000	243.789	0,20
Heidelberg Materials Finance Luxembourg SA, 4,875 %, 21.11.33 EMTN (i)	EUR	250.000	266.377	0,21
Highland Holdings Sarl, 0,318 %, 15.12.26 (i)	EUR	210.000	193.550	0,15
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07.03.27 (i)	EUR	655.000	618.971	0,50
Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02.07.39 (i)	EUR	350.000	266.966	0,21
Medtronic Global Holdings SCA, 1,625 %, 07.03.31 (i)	EUR	250.000	226.623	0,18
Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23.09.28 (i)	EUR	335.000	296.246	0,24
Prologis International Funding II SA 2,375 %, 14.11.30 (i)	EUR	360.000	330.859	0,26
Prologis International Funding II SA 3,625 %, 07.03.30 EMTN (i)	EUR	260.000	257.851	0,21
SEGRO Capital Sarl, 0,500 %, 22.09.31 (i)	EUR	280.000	219.520	0,18
SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	460.000	459.301	0,37
			5.474.202	4,39

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Niederlande - 14,56 % (31. Dezember 2022: 16,88 %)				
ABN AMRO Bank NV, 0,500 %, 23.09.29 EMTN (i)	EUR	500.000	424.515	0,34
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22.02.33 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	205.658	0,16
Airbus SE, 1,375 %, 13.05.31 EMTN (i)	EUR	210.000	188.054	0,15
Akelius Residential Property Financing BV, 1,000 %, 17.01.28 EMTN (i)	EUR	250.000	214.568	0,17
Alliander NV, 3,250 %, 13.06.28 EMTN (i)	EUR	310.000	316.026	0,25
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1,125 %, 17.09.25 (i)	EUR	500.000	482.100	0,39
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd., 2,750 %, 19.02.49 (i) (ii)	EUR	240.000	224.827	0,18
ASR Nederland NV, 3,375 %, 02.05.49 (i) (ii)	EUR	100.000	92.714	0,07
ASR Nederland NV, 5,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	99.886	0,08
ASR Nederland NV, 7,000 %, 07.12.43 (i) (ii)	EUR	100.000	112.610	0,09
BMW Finance NV, 4,125 %, 04.10.33 EMTN (i)	EUR	300.000	323.103	0,26
BP Capital Markets BV, 3,773 %, 12.05.30 EMTN (i)	EUR	300.000	310.246	0,25
BP Capital Markets BV, 4,323 %, 12.05.35 EMTN (i)	EUR	140.000	148.443	0,12
Citycon Treasury BV, 2,375 %, 15.01.27 EMTN (i)	EUR	200.000	174.582	0,14
Coca-Cola HBC Finance BV, 0,625 %, 21.11.29 (i)	EUR	600.000	519.116	0,42
Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08.03.30 EMTN (i)	EUR	490.000	487.677	0,39
CTP NV, 1,500 %, 27.09.31 EMTN (i)	EUR	200.000	154.745	0,12
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19.06.26 EMTN (i)	EUR	200.000	203.302	0,16
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19.06.29 EMTN (i)	EUR	400.000	413.013	0,33
de Volksbank NV, 1,750 %, 22.10.30 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	282.204	0,23
easyJet FinCo BV, 1,875 %, 03.03.28 EMTN (i)	EUR	260.000	242.701	0,19
EDP Finance BV, 1,875 %, 21.09.29 EMTN (i)	EUR	200.000	186.644	0,15
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	355.000	347.509	0,28
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29.09.47 (i) (ii)	EUR	285.000	271.443	0,22
Enel Finance International NV, 0,875 %, 17.01.31 EMTN (i)	EUR	300.000	252.989	0,20
Enel Finance International NV, 4,500 %, 20.02.43 EMTN (i)	EUR	300.000	308.726	0,25
Essity Capital BV, 3,000 %, 21.09.26 EMTN (i)	EUR	540.000	538.223	0,43
Euronext NV, 1,000 %, 18.04.25 (i)	EUR	300.000	289.715	0,23
Heimstaden Bostad Treasury BV, 1,625 %, 13.10.31 EMTN (i)	EUR	250.000	157.001	0,13
Heineken NV, 1,250 %, 17.03.27 EMTN (i)	EUR	400.000	378.439	0,30
Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)	EUR	500.000	470.625	0,38
ING Groep NV, 0,250 %, 18.02.29 (i) (ii)	EUR	900.000	780.548	0,63
ING Groep NV, 1,250 %, 16.02.27 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	285.337	0,23
ING Groep NV, 1,625 %, 26.09.29 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	194.966	0,16
ING Groep NV, 2,500 %, 15.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	299.132	0,24
JAB Holdings BV, 5,000 %, 12.06.33 (i)	EUR	200.000	215.452	0,17
Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0,375 %, 18.03.30 (i)	EUR	570.000	482.398	0,39
Lseg Netherlands BV, 4,125 %, 29.09.26 EMTN (i)	EUR	400.000	410.430	0,33
Mercedes-Benz International Finance BV, 1,000 %, 11.11.25 EMTN (i)	EUR	300.000	287.827	0,23
Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03.10.31 EMTN (i)	EUR	105.000	85.891	0,07
Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11.07.34 EMTN (i)	EUR	160.000	163.238	0,13
NN Group NV, 4,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	99.378	0,08

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Niederlande - 14,56 % (31. Dezember 2022: 16,88 %) (Fortsetzung)				
NN Group NV, 5,250 %, 03.01.43 EMTN (i) (ii)	EUR	175.000	178.634	0,14
PACCAR Financial Europe BV, Zero Coupon Bond, 01.03.26 EMTN (i)	EUR	390.000	364.382	0,29
Prosus NV, 2,085 %, 19.01.30 (i)	EUR	180.000	150.142	0,12
Shell International Finance BV, 1,625 %, 20.01.27 EMTN (i)	EUR	440.000	423.362	0,34
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09.09.30 EMTN (i)	EUR	100.000	99.508	0,08
Sika Capital BV, 3,750 %, 03.11.26 (i)	EUR	400.000	406.796	0,33
Stedin Holding NV, 0,875 %, 24.10.25 EMTN (i)	EUR	540.000	517.253	0,41
Stedin Holding NV, 2,375 %, 03.06.30 EMTN (i)	EUR	390.000	371.513	0,30
Stellantis NV, 4,250 %, 16.06.31 EMTN (i)	EUR	295.000	305.820	0,25
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	300.000	290.037	0,23
TenneT Holding BV, 1,375 %, 26.06.29 EMTN (i)	EUR	300.000	283.350	0,23
TenneT Holding BV, 1,500 %, 03.06.39 EMTN (i)	EUR	100.000	86.688	0,07
TenneT Holding BV, 4,500 %, 28.10.34 EMTN (i)	EUR	190.000	210.494	0,17
TenneT Holding BV, 4,750 %, 28.10.42 EMTN (i)	EUR	175.000	201.238	0,16
Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2,000 %, 18.10.51 (i)	EUR	300.000	214.401	0,17
Vesteda Finance BV, 0,750 %, 18.10.31 EMTN (i)	EUR	250.000	200.441	0,16
Vesteda Finance BV, 2,000 %, 10.07.26 EMTN (i)	EUR	600.000	576.582	0,46
Volkswagen International Finance NV, 3,748 % (i) (ii) (iii)	EUR	100.000	93.646	0,08
Vonovia Finance BV, 2,125 %, 22.03.30 EMTN (i)	EUR	100.000	89.374	0,07
Vonovia Finance BV, 2,250 %, 07.04.30 (i)	EUR	200.000	179.638	0,14
Wintershall Dea Finance 2 BV, 2,499 % (i) (ii) (iii)	EUR	200.000	181.000	0,14
Wintershall Dea Finance BV, 1,823 %, 25.09.31 (i)	EUR	300.000	256.392	0,21
WPC Eurobond BV, 0,950 %, 01.06.30 (i)	EUR	200.000	166.020	0,13
WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19.07.24 (i)	EUR	200.000	197.460	0,16
			18.170.172	14,56
Neuseeland - 0,49 % (31. Dezember 2022: 1,12 %)				
ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23.09.27 EMTN (i)	EUR	425.000	379.890	0,30
ASB Bank Ltd, 4,500 %, 16.03.27 EMTN (ii)	EUR	230.000	237.498	0,19
			617.388	0,49
Norwegen - 2,01 % (31. Dezember 2022: 2,29 %)				
DNB Bank ASA, 0,250 %, 23.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	570.000	499.713	0,40
DNB Bank ASA, 0,375 %, 18.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	290.000	265.662	0,21
Equinor ASA, 1,250 %, 17.02.27 EMTN (i)	EUR	340.000	322.132	0,26
Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 25.02.25 EMTN (i)	EUR	300.000	287.780	0,23
Santander Consumer Bank AS, 0,500 %, 11.08.25 EMTN (i)	EUR	300.000	285.120	0,23
Statnett SF, 0,875 %, 08.03.25 EMTN (i)	EUR	225.000	218.039	0,18
Telenor ASA, 0,750 %, 31.05.26 EMTN (i)	EUR	330.000	312.292	0,25
Variable Energi ASA, 5,500 %, 04.05.29 EMTN (i)	EUR	295.000	315.485	0,25
			2.506.223	2,01
Portugal - 0,55 % (31. Dezember 2022: 0,64 %)				
EDP - Energias de Portugal SA, 1,700 %, 20.07.80 (i) (ii)	EUR	300.000	286.458	0,23
EDP - Energias de Portugal SA, 2,875 %, 01.06.26 EMTN (i)	EUR	400.000	396.569	0,32
			683.027	0,55
Spanien - 3,59 % (31. Dezember 2022: 3,66 %)				
Aena SME SA, 4,250 %, 13.10.30 EMTN (i)	EUR	200.000	212.770	0,17
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,125 %, 24.03.27 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	372.329	0,30
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, 02.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	309.642	0,25

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Spanien – 3,59 % (31. Dezember 2022: 3,66 %) (Fortsetzung)				
Banco de Sabadell SA, 5,500 %, 09.08.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	311.895	0,25
Banco Santander SA, 0,500 %, 24.03.27 EMTN (i) (ii)	EUR	400.000	373.035	0,30
Banco Santander SA, 3,875 %, 16.01.28 EMTN (i)	EUR	300.000	307.116	0,25
Banco Santander SA, 4,875 %, 18.10.31 EMTN (i)	EUR	300.000	319.496	0,25
Banco Santander SA, 5,750 %, 23.08.33 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	209.733	0,17
CaixaBank SA, 0,375 %, 18.11.26 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	282.174	0,23
CaixaBank SA, 0,625 %, 21.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	276.663	0,22
CaixaBank SA, 2,250 %, 17.04.30 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	289.557	0,23
CaixaBank SA, 3,750 %, 15.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	299.550	0,24
CaixaBank SA, 4,250 %, 06.09.30 EMTN (i)	EUR	400.000	415.160	0,33
CaixaBank SA, 5,000 %, 19.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	200.000	209.064	0,17
Telefonica Emisiones SA, 2,318 %, 17.10.28 EMTN (i)	EUR	300.000	289.119	0,23
			4.477.303	3,59
Schweden - 3,11 % (31. Dezember 2022: 2,70 %)				
EQT AB, 2,375 %, 06.04.28 (i)	EUR	170.000	160.288	0,13
Molnlycke Holding AB, 4,250 %, 08.09.28 EMTN (i)	EUR	365.000	374.932	0,30
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,750 %, 11.11.26 EMTN (i)	EUR	300.000	288.140	0,23
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4,125 %, 29.06.27 EMTN (i)	EUR	310.000	319.388	0,26
Svenska Handelsbanken AB, 3,375 %, 17.02.28 (i)	EUR	200.000	201.786	0,16
Swedbank AB, 1,300 %, 17.02.27 EMTN (i)	EUR	650.000	604.956	0,48
Swedbank AB, 3,625 %, 23.08.32 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	293.434	0,24
Swedbank AB, 4,125 %, 13.11.28 EMTN (i)	EUR	350.000	362.611	0,29
Vattenfall AB, 0,125 %, 12.02.29 EMTN (i)	EUR	220.000	190.259	0,15
Vattenfall AB, 3,750 %, 18.10.26 EMTN (i)	EUR	495.000	503.145	0,40
Volvo Treasury AB, 3,875 %, 29.08.26 EMTN (i)	EUR	570.000	580.960	0,47
			3.879.899	3,11
Schweiz - 2,24 % (31. Dezember 2022: 2,29 %)				
Credit Suisse AG, 5,500 %, 20.08.26 EMTN (i)	EUR	730.000	767.471	0,61
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4,840 %, 03.11.28 EMTN (i)	EUR	300.000	313.375	0,25
UBS AG, 0,500 %, 31.03.31 EMTN (i)	EUR	330.000	269.643	0,22
UBS Group AG, 0,250%, 03.11.26 (i) (ii)	EUR	760.000	712.567	0,57
UBS Group AG, 0,625 %, 18.01.33 EMTN (i)	EUR	365.000	275.244	0,22
UBS Group AG, 0,650 %, 14.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	500.000	456.749	0,37
			2.795.049	2,24
Vereinigtes Königreich - 6,80 % (31. Dezember 2022: 7,35 %)				
AstraZeneca PLC, 0,375 %, 03.06.29 EMTN (i)	EUR	300.000	263.933	0,21
AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03.03.32 EMTN (i)	EUR	265.000	278.767	0,22
BG Energy Capital PLC, 2,250 %, 21.11.29 EMTN (i)	EUR	570.000	539.603	0,43
BP Capital Markets PLC, 3,250 % (i) (ii) (iii)	EUR	355.000	342.575	0,28
Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31.07.26 (i)	EUR	470.000	436.991	0,35
Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31.07.31 (i)	EUR	280.000	234.984	0,19
DS Smith PLC, 0,875 %, 12.09.26 EMTN (i)	EUR	300.000	279.868	0,23
DS Smith PLC, 4,500 %, 27.07.30 EMTN (i)	EUR	370.000	385.248	0,31
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12.09.29 (i)	EUR	200.000	185.234	0,15
HSBC Holdings PLC, 3,019 %, 15.06.27 (i) (ii)	EUR	390.000	385.219	0,31
HSBC Holdings PLC, 4,787 %, 10.03.32 EMTN (i) (ii)	EUR	300.000	317.064	0,25
HSBC Holdings PLC, 6,364 %, 16.11.32 (i) (ii)	EUR	265.000	284.891	0,23
International Distributions Services PLC, 5,250 %, 14.09.28 (i)	EUR	325.000	337.386	0,27

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich – 6,80 % (31. Dezember 2022: 7,35 %) (Fortsetzung)				
National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05.04.30 EMTN (i)	EUR	325.000	337.443	0,27
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20.09.28 EMTN (i)	EUR	930.000	943.686	0,76
Nationwide Building Society, 4,500 %, 01.11.26 EMTN (i)	EUR	560.000	577.450	0,46
NatWest Group PLC, 1,750 %, 02.03.26 EMTN (i) (ii)	EUR	555.000	540.235	0,43
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3,875 %, 14.09.33 EMTN (i)	EUR	485.000	513.867	0,41
SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	230.000	222.546	0,18
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	350.000	317.065	0,25
Standard Chartered PLC, 1,625 %, 03.10.27 EMTN (i) (ii)	EUR	500.000	473.605	0,38
Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24.11.30 EMTN (i)	EUR	315.000	285.619	0,23
			8.483.279	6,80
Vereinigte Staaten - 16,38 % (31. Dezember 2022: 16,01 %)				
AbbVie Inc, 2,125 %, 17.11.28	EUR	330.000	317.863	0,25
American Tower Corp, 0,400 %, 15.02.27	EUR	360.000	327.899	0,26
American Tower Corp, 0,450 %, 15.01.27	EUR	200.000	182.888	0,15
American Tower Corp, 0,875 %, 21.05.29	EUR	310.000	270.092	0,22
AT&T Inc, 1.600 %, 19.05.28	EUR	1.280.000	1.201.033	0,96
AT&T Inc, 4,300 %, 18.11.34	EUR	335.000	353.814	0,28
Bank of America Corp, 1,381 %, 09.05.30 EMTN (ii)	EUR	335.000	299.335	0,24
Bank of America Corp, 1,662 %, 25.04.28 EMTN (ii)	EUR	405.000	382.684	0,31
Bank of America Corp, 1,776 %, 04.05.27 EMTN (ii)	EUR	660.000	633.648	0,51
Berkshire Hathaway Finance Corp, 1,500 %, 18.03.30	EUR	575.000	521.503	0,42
BMW US Capital LLC, 1,000 %, 20.04.27 EMTN	EUR	350.000	330.002	0,26
Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15.05.29	EUR	315.000	333.253	0,27
Cargill Inc, 3,875%, 4/24/30	EUR	400.000	415.408	0,33
Carrier Global Corp, 4,375 %, 29.05.25	EUR	320.000	322.701	0,26
Carrier Global Corp, 4,500 %, 29.11.32	EUR	200.000	214.071	0,17
Chubb INA Holdings Inc, 0,300 %, 15.12.24	EUR	260.000	251.663	0,20
Chubb INA Holdings Inc, 1,400 %, 15.06.31	EUR	335.000	294.792	0,24
Citigroup Inc, 1,500 %, 24.07.26 EMTN (ii)	EUR	285.000	275.050	0,22
Citigroup Inc, 2,125 %, 10.09.26 EMTN	EUR	285.000	274.354	0,22
Coca-Cola Co, 0,400 %, 06.05.30	EUR	330.000	283.455	0,23
Eli Lilly & Co, 1,125 %, 14.09.51	EUR	160.000	103.929	0,08
FedEx Corp, 1,625 %, 11.01.27	EUR	175.000	167.372	0,13
Fiserv Inc, 4,500 %, 24.05.31	EUR	485.000	513.799	0,41
Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15.09.25 EMTN	EUR	285.000	281.130	0,22
General Mills Inc, 3,907 %, 13.04.29	EUR	380.000	392.096	0,31
General Motors Financial Co Inc, 4,500 %, 22.11.27 EMTN	EUR	140.000	145.012	0,12
Goldman Sachs Group Inc, 1,250 %, 01.05.25 EMTN	EUR	600.000	580.664	0,47
Goldman Sachs Group Inc, 1,250 %, 07.02.29 EMTN	EUR	400.000	357.856	0,29
Illinois Tool Works Inc, 0,625 %, 05.12.27	EUR	335.000	308.173	0,25
International Business Machines Corp, 3,625 %, 06.02.31	EUR	400.000	412.472	0,33
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, 24.02.28 EMTN (ii)	EUR	575.000	523.477	0,42
JPMorgan Chase & Co, 1,001 %, 25.07.31 EMTN (ii)	EUR	610.000	520.196	0,42
McDonald's Corp, 1,500 %, 28.11.29	EUR	500.000	457.150	0,37
Merck & Co Inc, 0,500 %, 02.11.24	EUR	210.000	204.396	0,16
Molson Coors Beverage Co, 1,250 %, 15.07.24	EUR	340.000	334.700	0,27
Morgan Stanley, 0,406 %, 29.10.27 (ii)	EUR	250.000	229.462	0,18
Morgan Stanley, 4,656 %, 02.03.29 (ii)	EUR	760.000	789.355	0,63

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten – 16,38 % (31. Dezember 2022: 16,01 %) (Fortsetzung)				
National Grid North America Inc, 4,668 %, 12.09.33 EMTN	EUR	275.000	293.587	0,23
Netflix Inc, 4,625 %, 15.05.29	EUR	305.000	325.429	0,26
PPG Industries Inc, 2,750 %, 01.06.29	EUR	305.000	297.935	0,24
Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, 08.02.29 EMTN	EUR	690.000	611.958	0,49
Realty Income Corp, 4,875 %, 06.07.30	EUR	275.000	291.379	0,23
RTX Corp, 2,150 %, 18.05.30	EUR	200.000	183.310	0,15
Tapestry Inc, 5,375 %, 27.11.27	EUR	165.000	170.999	0,14
Tapestry Inc, 5,875 %, 27.11.31	EUR	200.000	210.332	0,17
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01.10.31	EUR	760.000	648.447	0,52
Thermo Fisher Scientific Inc, 2,000 %, 15.04.25	EUR	300.000	293.806	0,24
Toyota Motor Credit Corp, 0,250 %, 16.07.26 EMTN	EUR	310.000	289.260	0,23
Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13.09.29 EMTN	EUR	360.000	377.675	0,30
Unilever Capital Corp, 3,300 %, 06.06.29 EMTN	EUR	155.000	158.519	0,13
Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06.06.33 EMTN	EUR	330.000	339.666	0,27
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31.10.30	EUR	1.045.000	1.107.311	0,89
Visa Inc, 1,500 %, 15.06.26	EUR	540.000	521.602	0,42
Wells Fargo & Co, 1,000 %, 02.02.27 EMTN	EUR	275.000	255.203	0,20
Wells Fargo & Co, 1,741 %, 04.05.30 EMTN (ii)	EUR	290.000	263.521	0,21
			20.446.686	16,38
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**121.332.450**	**97,23**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**121.332.450**	**97,23**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: EUR 118.273.704)			**121.332.450**	**97,23**

FINANZDERIVATE – 0,04 % (31. Dezember 2022: (0,32 %))

Offene Devisenterminkontrakte - (0,01 %) (31. Dezember 2022: 0,00 %)

Fälligkeits-datum	**Käufe**	**Verkäufe**	**Kontrahent**	**Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD**	**% des Nettovermögens**
1/3/24	USD 738.815	EUR 683.637	Brown Brothers Harriman	(14.814)	(0,01 %)
1/3/24	EUR 664.483	USD 738.815	Brown Brothers Harriman	(4.340)	(0,01 %)
1/31/24	USD 719.910	EUR 666.211	Brown Brothers Harriman	(15.283)	(0,01 %)
1/31/24	USD 18.905	EUR 17.484	Brown Brothers Harriman	(390)	(0,00 %)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

FINANZDERIVATE (Fortsetzung)

Offene Devisenterminkontrakte – (0,01 %) (31. Dezember 2022: 0,00 %) (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Käufe	Verkäufe	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) USD	% des Nettovermögens
1/31/24	USD 15.179	EUR 13.704	Brown Brothers Harriman	21	0,00 %
1/31/24	USD 738.815	EUR 664.483	Brown Brothers Harriman	3.538	0,01 %
1/31/24	EUR 683.694	USD 738.815	Brown Brothers Harriman	15.673	0,01 %
Nicht realisierter Gewinn aus offenen Devisenterminkontrakten				19.232	0,02 %
Nicht realisierter Verlust aus offenen Devisenterminkontrakten				(34.827)	(0,03 %)
Nicht realisierter Nettoverlust aus offenen Devisenterminkontrakten				**(15.595)**	**(0,01 %)**

Futures - 0,05 % (31. Dezember 2022: (0,32 %))

Anzahl Kontrakte	Beschreibung	Kontrahent	Engagement	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	% des Nettovermögens
(84)	Euro-Bobl March 2024 Futures	JP Morgan	9.880.920	(138.600)	(0,11 %)
48	Euro-Bund March 2024 Futures	JP Morgan	6.414.600	171.960	0,14 %
76	Euro-Schatz March 2024 Futures	JP Morgan	8.071.200	26.220	0,02 %
Nicht realisierter Gewinn aus Futures				198.180	0,16 %
Nicht realisierter Verlust aus Futures				(138.600)	(0,11 %)
Nicht realisierter Nettogewinn auf Futures				**59.580**	**0,05 %**

	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**121.549.862**	**97,40**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(173.427)**	**(0,14)**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**121.376.435**	**97,26**
Bankguthaben	1.692.475	1,36
Sonstige Vermögenswerte	2.251.099	1,80
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(526.009)	(0,42)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**124.794.000**	**100,00**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

ZEHN GRÖSSTE BETEILIGUNGEN NACH SEKTOREN ZUM 31. DEZEMBER 2023 IN PROZENT DES NETTOVERMÖGENS

Banken	32,14 %
Elektro	8,68 %
Autos	5,74 %
Telekommunikation	4,04 %
Erdöl & -gas	3,84 %
Versicherung	3,60 %
Gesundheit	3,22 %
Real Estate Investment Trusts	2,92 %
Real Estate	2,90 %
Staatsanleihen	2,74 %

(i) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(ii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(iii) Ewige Anleihen.

Abkürzungen:

EUR: Euro
USD: US-Dollar

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögens**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	96,81
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	0,16
Finanzderivate	(0,12)
Umlaufvermögen	3,15
	100,00

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN – 98,10 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,76 %)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN – 98,10 % DES NETTOVERMÖGENS (31. Dezember 2022: 97,76 %)				
Australien - 0,67 % (31. Dezember 2022: 0,12 %)				
APA Infrastructure Ltd, 1,250 %, 15.03.33 EMTN (i)	EUR	2.700.000	2.176.092	0,25
National Australia Bank Ltd, 1,375 %, 30.08.28 EMTN (i)	EUR	3.880.000	3.585.679	0,42
			5.761.771	0,67
Österreich - 1,21 % (31. Dezember 2022: 1,26 %)				
BAWAG PSK Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse AG, 4,125 %, 18.01.27 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.722.457	0,20
Erste Group Bank AG, 0,250 %, 14.09.29 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.022.485	0,24
Erste Group Bank AG, 1,625 %, 08.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	2.200.000	2.051.500	0,24
Erste Group Bank AG, 4,250 %, 30.05.30 EMTN (i) (ii)	EUR	2.200.000	2.284.056	0,27
Raiffeisen Bank International AG, 0,050 %, 01.09.27 EMTN (ii)	EUR	2.600.000	2.266.378	0,26
			10.346.876	1,21
Belgien - 3,26 % (31. Dezember 2022: 2,83 %)				
Ageas SA, 3,250 %, 02.07.49 (i) (ii)	EUR	1.300.000	1.212.403	0,14
Belfius Bank SA, 3,875 %, 12.06.28 EMTN (i)	EUR	1.900.000	1.944.654	0,23
Belfius Bank SA, 4,125 %, 12.09.29 EMTN (i)	EUR	1.500.000	1.552.903	0,18
Elia Transmission Belgium SA, 0,875 %, 28.04.30 EMTN (i)	EUR	4.900.000	4.271.085	0,50
Elia Transmission Belgium SA, 1,375 %, 14.01.26 EMTN (i)	EUR	700.000	672.756	0,08
Euroclear Bank SA, 3,625 %, 13.10.27 EMTN (i)	EUR	1.600.000	1.631.453	0,19
FLUVIUS System Operator CVBA, 0,250 %, 14.06.28 EMTN (i)	EUR	1.600.000	1.415.136	0,16
FLUVIUS System Operator CVBA, 3,875 %, 18.03.31 EMTN (i)	EUR	2.600.000	2.694.417	0,31
KBC Group NV, 0,750 %, 21.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	2.900.000	2.667.014	0,31
KBC Group NV, 1,625 %, 18.09.29 EMTN (i) (ii)	EUR	2.400.000	2.338.243	0,27
KBC Group NV, 4,250 %, 28.11.29 EMTN (i) (ii)	EUR	3.900.000	4.007.366	0,47
Lonza Finance International NV, 1,625 %, 21.04.27 (i)	EUR	1.320.000	1.264.618	0,15
Lonza Finance International NV, 3,875 %, 25.05.33 (i)	EUR	2.225.000	2.311.002	0,27
			27.983.050	3,26
Kanada - 0,44 % (31. Dezember 2022: 0,65 %)				
Great-West Lifeco Inc, 4,700 %, 16.11.29	EUR	2.070.000	2.218.463	0,26
Magna International Inc, 4,375 %, 17.03.32	EUR	1.455.000	1.551.568	0,18
			3.770.031	0,44
Dänemark - 0,72 % (31. Dezember 2022: 1,09 %)				
Jyske Bank A/S, 0,250 %, 17.02.28 EMTN (i) (ii)	EUR	2.255.000	2.045.939	0,24
Nykredit Realkredit AS, 4,625 %, 19.01.29 EMTN (i)	EUR	2.550.000	2.634.206	0,30
Pandora A/S, 4,500 %, 10.04.28 EMTN (i)	EUR	1.480.000	1.534.414	0,18
			6.214.559	0,72
Finnland - 1,80 % (31. Dezember 2022: 0,09 %)				
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 0,875 %, 17.09.29 EMTN (i)	EUR	2.025.000	1.556.136	0,18
Castellum Helsinki Finance Holding Abp, 2,000 %, 24.03.25 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.252.762	0,15
Kojamo OYJ, 1,500 %, 19.06.24 (i)	EUR	1.700.000	1.666.825	0,19
Nordea Bank Abp, 0,625 %, 18.08.31 EMTN (i) (ii)	EUR	3.485.000	3.200.910	0,37
Nordea Bank Abp, 1,125 %, 16.02.27 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.191.682	0,37
OP Corporate Bank PLC, 1,625 %, 09.06.30 (i) (ii)	EUR	935.000	893.205	0,10
Sampo OYJ, 3,375 %, 23.05.49 (i) (ii)	EUR	500.000	470.532	0,06
Teollisuuden Voima OYJ, 2,625 %, 31.03.27 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.252.722	0,15
Teollisuuden Voima OYJ, 4,750 %, 01.06.30 EMTN (i)	EUR	1.845.000	1.930.608	0,23
			15.415.382	1,80

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Frankreich - 18,77 % (31. Dezember 2022: 15,14 %)				
Aeroports de Paris SA, 2,125 %, 02.10.26 (i)	EUR	3.500.000	3.423.945	0,40
ALD SA, 1,250 %, 02.03.26 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.335.824	0,16
ALD SA, 4,250 %, 18.01.27 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.328.787	0,16
ALD SA, 4.375 %, 23.11.26 (i)	EUR	2.300.000	2.355.237	0,27
Alstom SA, 0,125 %, 27.07.27 (i)	EUR	1.000.000	876.483	0,10
APRR SA, 1,500 %, 25.01.30 EMTN (i)	EUR	1.900.000	1.749.759	0,20
APRR SA, 3,125 %, 24.01.30 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.427.548	0,40
Arval Service Lease SA, 4,125 %, 13.04.26 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.416.310	0,17
AXA SA, 1,875 %, 10.07.42 EMTN (i) (ii)	EUR	2.395.000	1.971.549	0,23
AXA SA, 3,941 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	1.300.000	1.283.750	0,15
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,250 %, 29.06.28 EMTN (i)	EUR	4.500.000	3.959.559	0,46
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,625 %, 03.11.28 EMTN (i)	EUR	3.100.000	2.710.299	0,32
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,250 %, 26.05.27 EMTN (i)	EUR	700.000	656.075	0,08
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,875 %, 18.06.29 EMTN (i)	EUR	2.500.000	2.280.180	0,27
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4,125 %, 14.06.28 EMTN (i)	EUR	3.000.000	3.149.142	0,37
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 4,750 %, 10.11.31 EMTN (i)	EUR	2.300.000	2.441.598	0,28
Banque Stellantis France SACA, 3,875 %, 19.01.26 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.308.939	0,15
BNP Paribas SA, 0,250 %, 13.04.27 EMTN (i) (ii)	EUR	4.900.000	4.548.097	0,53
BNP Paribas SA, 1,125 %, 17.04.29 EMTN (i) (ii)	EUR	2.500.000	2.255.625	0,26
BNP Paribas SA, 2,500 %, 31.03.32 EMTN (i) (ii)	EUR	1.800.000	1.702.250	0,20
BNP Paribas SA, 3,625 % 01.09.29 EMTN (i)	EUR	4.400.000	4.417.120	0,52
BNP Paribas SA, 3,875 %, 23.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	2.600.000	2.657.866	0,31
Bouygues SA, 3,875 %, 17.07.31 (i)	EUR	2.900.000	3.023.064	0,35
Bouygues SA, 5,375 %, 30.06.42 (i)	EUR	1.000.000	1.188.166	0,14
Carrefour SA, 4,375 %, 14.11.31 EMTN (i)	EUR	2.200.000	2.331.450	0,27
Cie de Saint-Gobain, 3,875 %, 29.11.30 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.513.812	0,41
CNP Assurances SACA, 1,250 %, 27.01.29 (i)	EUR	500.000	441.281	0,05
CNP Assurances SACA, 5,250 %, 18.07.53 EMTN (i) (ii)	EUR	800.000	826.037	0,10
Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 0,875 %, 29.09.24 (i)	EUR	2.500.000	2.442.500	0,28
Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 2,125 %, 29.07.32 (i)	EUR	2.200.000	1.991.185	0,23
Covivio SA, 4,625 %, 05.06.32 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.488.346	0,29
Credit Agricole Assurances SA, 2,625 %, 29.01.48 (i) (ii)	EUR	1.800.000	1.669.479	0,19
Credit Agricole SA, 1,875 %, 22.04.27 (i) (ii)	EUR	6.200.000	5.977.420	0,70
Credit Agricole SA, 2,625 %, 17.03.27 (i)	EUR	965.000	934.773	0,11
Credit Agricole SA, 3,375 %, 28.07.27 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.710.870	0,20
Credit Agricole SA, 4,250 %, 11.07.29 (i) (ii)	EUR	1.900.000	1.960.954	0,23
Credit Mutuel Arkea SA, 3,375 %, 19.09.27 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.407.517	0,28
Danone SA, 3,470 %, 22.05.31 EMTN (i)	EUR	4.300.000	4.416.151	0,51
Electricite de France SA, 2,000 %, 09.12.49 EMTN (i)	EUR	1.800.000	1.193.310	0,14
Electricite de France SA, 3,750 %, 05.06.27 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.446.781	0,29
ELO SACA, 6,000 %, 22.03.29 EMTN (i)	EUR	2.200.000	2.231.403	0,26
Engie SA, 1,500 % (i) (ii) (iii)	EUR	1.900.000	1.672.369	0,20
Engie SA, 3,625 %, 11.01.30 EMTN (i)	EUR	4.000.000	4.106.128	0,48
Firmenich Productions Participations SAS, 1,750 %, 30.04.30 (i)	EUR	1.755.000	1.625.407	0,19

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Frankreich – 18,77 % (31. Dezember 2022: 15,14 %) (Fortsetzung)				
Gecina SA, 0,875 %, 30.06.36 EMTN (i)	EUR	2.000.000	1.477.940	0,17
Gecina SA, 1,625 %, 14.03.30 EMTN (i)	EUR	1.500.000	1.387.500	0,16
Banque Federative du Credit Mutuel SADIR, 1,850 %, 21.04.42 (i) (ii)	EUR	600.000	484.188	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,475 %, 18.01.31 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.456.050	0,17
HSBC Continental Europe SA, 1,375 %, 04.09.28 EMTN (i)	EUR	1.800.000	1.658.642	0,19
Klepierre SA, 0,625 %, 01.07.30 EMTN (i)	EUR	2.500.000	2.078.720	0,24
La Poste SA, 0,375 %, 17.09.27 EMTN (i)	EUR	2.500.000	2.274.260	0,27
La Poste SA, 3,750 %, 12.06.30 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.758.779	0,21
Legrand SA, 3,500 %, 29.05.29 (i)	EUR	1.600.000	1.652.752	0,19
Orange SA, 5,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	1.300.000	1.359.189	0,16
Orano SA, 5,375 %, 15.05.27 EMTN (i)	EUR	800.000	836.763	0,10
Praemia Healthcare SACA, 0,875 %, 04.11.29 (i)	EUR	2.200.000	1.817.563	0,21
Praemia Healthcare SACA, 5,500 %, 19.09.28 (i)	EUR	1.100.000	1.151.525	0,13
RCI Banque SA, 4,500 %, 06.04.27 EMTN (i)	EUR	4.595.000	4.719.978	0,55
RCI Banque SA, 4,625 %, 02.10.26 EMTN (i)	EUR	2.135.000	2.191.526	0,26
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1,625 %, 27.11.25 EMTN (i)	EUR	2.200.000	2.139.174	0,25
RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 3,750 %, 04.07.35 EMTN (i)	EUR	3.300.000	3.446.876	0,40
Sanofi SA, 1,250 %, 06.04.29 (i)	EUR	2.400.000	2.231.979	0,26
Sanofi SA, 1,375 %, 21.03.30 EMTN (i)	EUR	2.300.000	2.122.104	0,25
Societe Generale SA, 0,125 %, 17.11.26 (i) (ii)	EUR	3.000.000	2.816.862	0,33
Societe Generale SA, 0,500 %, 12.06.29 (i) (ii)	EUR	2.500.000	2.166.580	0,25
Societe Generale SA, 0,625 %, 02.12.27 (i) (ii)	EUR	4.500.000	4.123.539	0,48
Societe Generale SA, 4,125 %, 02.06.27 (i)	EUR	1.700.000	1.743.149	0,20
Societe Generale SA, 4,125 %, 21.11.28 EMTN (i)	EUR	2.000.000	2.072.068	0,24
Societe Generale SA, 5,625 %, 02.06.33 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.492.075	0,17
Suez SACA, 2,375 %, 24.05.30 EMTN (i)	EUR	2.100.000	1.978.935	0,23
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,625 %, 04.05.27 EMTN (i)	EUR	3.100.000	2.832.197	0,33
Unibail-Rodamco-Westfield SE, 0,875 %, 29.03.32 EMTN (i)	EUR	1.200.000	958.831	0,11
Verallia SA, 1,875 %, 10.11.31 (i)	EUR	1.800.000	1.579.522	0,18
WPP Finance SA, 4,125 %, 30.05.28 EMTN (i)	EUR	1.085.000	1.119.649	0,13
			160.983.260	18,77
Deutschland - 9,85 % (31. Dezember 2022: 8,49 %)				
Allianz SE, 4,597 %, 07.09.38 EMTN (i) (ii)	EUR	2.500.000	2.559.660	0,30
Allianz SE, 5,824 %, 25.07.53 (i) (ii)	EUR	1.900.000	2.081.010	0,24
Amprion GmbH, 0,625 %, 23.09.33 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.083.306	0,13
Amprion GmbH, 3,971 %, 22.09.32 (i)	EUR	500.000	520.925	0,06
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 29.05.29 (i)	EUR	1.400.000	1.418.066	0,17
Bertelsmann SE & Co KGaA, 3,500 %, 23.04.75 EMTN (i) (ii)	EUR	2.300.000	2.190.980	0,26
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15.02.25 (i)	EUR	1.550.000	1.509.343	0,18
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, 15.02.28 (i)	EUR	1.500.000	1.416.128	0,17
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 15.08.24 (i)	EUR	1.000.000	985.276	0,11
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, 04.07.44 (i)	EUR	1.315.000	1.358.158	0,16
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4,000 %, 04.01.37 (i)	EUR	10.510.000	12.645.779	1,47
Commerzbank AG, 3,000 %, 14.09.27 (i) (ii)	EUR	1.700.000	1.664.634	0,19
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,375 %, 03.03.34 EMTN (i)	EUR	5.350.000	4.580.295	0,53
Deutsche Bahn Finance GmbH, 1,600 % (i) (ii) (iii)	EUR	3.500.000	2.948.750	0,34

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Deutschland – 9,85 % (31. Dezember 2022: 8,49 %) (Fortsetzung)				
Deutsche Bahn Finance GmbH, 4,000 %, 23.11.43 EMTN (i)	EUR	850.000	928.603	0,11
Deutsche Bank AG, 1,375 %, 03.09.26 EMTN (i) (ii)	EUR	3.400.000	3.255.452	0,38
Deutsche Bank AG, 1,750 %, 19.11.30 EMTN (i) (ii)	EUR	3.700.000	3.213.324	0,37
Deutsche Börse AG, 3,750 %, 28.09.29 (i)	EUR	6.400.000	6.658.629	0,78
Deutsche Börse AG, 3,875 %, 28.09.26 (i)	EUR	3.000.000	3.066.319	0,36
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16.05.27 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.344.812	0,16
Deutsche Telekom AG, 3,375 %, 03.07.33 EMTN (i)	EUR	1.670.000	1.704.249	0,20
Eurogrid GmbH, 3,722 %, 27.04.30 EMTN (i)	EUR	800.000	815.514	0,09
Hannover Rueck SE, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	700.000	687.393	0,08
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, 01.11.28 EMTN (i)	EUR	2.300.000	2.017.383	0,24
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, Zero Coupon Bond, 01.11.24 EMTN (i)	EUR	2.700.000	2.607.066	0,30
Infineon Technologies AG, 1,625 %, 24.06.29 EMTN (i)	EUR	3.100.000	2.871.084	0,33
Knorr-Bremse AG, 3,250 %, 21.09.27 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.426.153	0,40
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,125 %, 09.01.32 EMTN (i)	EUR	1.195.000	989.893	0,12
LANXESS AG, 0,625 %, 01.12.29 EMTN (i)	EUR	1.200.000	975.917	0,11
Merck Financial Services GmbH, 0,500 %, 16.07.28 EMTN (i)	EUR	3.000.000	2.696.748	0,31
Merck KGaA, 1,625 %, 09.09.80 (i) (ii)	EUR	2.100.000	1.945.268	0,23
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, 26.05.49 (i) (ii)	EUR	900.000	870.750	0,10
Robert Bosch GmbH, 4,375 %, 02.06.43 EMTN (i)	EUR	2.700.000	2.894.540	0,34
Talanx AG, 4,000 %, 25.10.29 EMTN (i)	EUR	3.300.000	3.435.524	0,40
Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, 26.09.32 EMTN (i)	EUR	1.000.000	1.087.337	0,13
			84.454.268	9,85
Irland - 2,23 % (31. Dezember 2022: 2,48 %)				
Abbott Ireland Financing DAC, 1,500 %, 27.09.26 (i)	EUR	1.705.000	1.644.815	0,19
AIB Group PLC, 1,875 %, 19.11.29 EMTN (i) (ii)	EUR	3.120.000	3.032.109	0,35
AIB Group PLC, 5,750 %, 16.02.29 (i) (ii)	EUR	1.350.000	1.450.837	0,17
Bank of Ireland Group PLC, 1,875 %, 05.06.26 EMTN (i) (ii)	EUR	1.600.000	1.555.875	0,18
CCEP Finance Ireland DAC, Zero Coupon Bond, 06.09.25 (i)	EUR	3.700.000	3.498.101	0,41
Linde PLC, 3,625 %, 12.06.34 (i)	EUR	1.400.000	1.465.302	0,17
Lunar Funding V for Swisscom AG, 1,125 %, 12.10.26 (i)	EUR	2.060.000	1.959.056	0,23
Permanent TSB Group Holdings PLC, 6,625 %, 25.04.28 (i) (ii)	EUR	1.895.000	1.998.619	0,23
Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2,875 %, 15.01.26 (i)	EUR	2.575.000	2.535.345	0,30
			19.140.059	2,23
Italien - 2,27 % (31. Dezember 2022: 3,13 %)				
ASTM SpA, 1,500 %, 25.01.30 EMTN (i)	EUR	1.200.000	1.042.910	0,12
Infrastrutture Wireless Italiane SpA, 1,875 %, 08.07.26 (i)	EUR	2.525.000	2.425.757	0,28
Intesa Sanpaolo SpA, 2,125 %, 26.05.25 EMTN (i)	EUR	1.450.000	1.420.551	0,17
Intesa Sanpaolo SpA, 4,000 %, 19.05.26 EMTN (i)	EUR	2.200.000	2.231.328	0,26
Intesa Sanpaolo SpA, 4,875 %, 19.05.30 EMTN (i)	EUR	4.250.000	4.468.578	0,52
Intesa Sanpaolo SpA, 5.000 %, 08.03.28 EMTN (i) (ii)	EUR	1.265.000	1.308.395	0,15
Poste Italiane SpA, 2,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	1.080.000	886.887	0,10
Snam SpA, 0,750 %, 17.06.30 EMTN (i)	EUR	3.075.000	2.610.527	0,31
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 0,375 %, 25.09.30 EMTN (i)	EUR	2.080.000	1.719.827	0,20
Terna - Rete Elettrica Nazionale, 3,625 %, 21.04.29 EMTN (i)	EUR	1.310.000	1.336.771	0,16
			19.451.531	2,27

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Japan - 0,42 % (31. Dezember 2022: 0,00 %)				
Takeda Pharmaceutical Co Ltd., 3,000 %, 21.11.30 (i)	EUR	3.655.000	3.603.377	0,42
			3.603.377	0,42
Jersey, Kanalinseln - 0,38 % (31. Dezember 2022: 0,36 %)				
Heathrow Funding Ltd, 1,125 %, 08.10.30 EMTN (i)	EUR	2.380.000	2.035.062	0,23
Heathrow Funding Ltd, 1,875 %, 12.07.32 EMTN (i)	EUR	1.450.000	1.268.234	0,15
			3.303.296	0,38
Liechtenstein - 0,38 % (31. Dezember 2022: 0,57 %)				
Swiss Life Finance I Ltd, 0,500 %, 15.09.31 (i)	EUR	3.550.000	2.875.479	0,33
Swiss Life Finance I Ltd, 3,250 %, 31.08.29 (i)	EUR	400.000	400.817	0,05
			3.276.296	0,38
Luxemburg - 4,32 % (31. Dezember 2022: 6,08 %)				
Aroundtown SA, 1,450 %, 09.07.28 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.322.872	0,15
Aroundtown SA, 1,625 %, 31.01.28 EMTN (i)	EUR	600.000	485.280	0,06
Aroundtown SA, 2,875 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	600.000	210.357	0,02
Aroundtown SA, 3,375 % (i) (ii) (iii)	EUR	500.000	202.024	0,02
CNH Industrial Finance Europe SA, 1,875 %, 19.01.26 EMTN (i)	EUR	2.495.000	2.421.817	0,28
CPI Property Group SA, 1,750 %, 14.01.30 EMTN (i)	EUR	1.100.000	621.689	0,07
DH Europe Finance II Sarl, 0,450 %, 18.03.28 (i)	EUR	4.100.000	3.703.899	0,43
Euroclear Investments SA, 1,125 %, 07.12.26 (i)	EUR	1.400.000	1.331.175	0,15
Euroclear Investments SA, 2,625 %, 11.04.48 (i) (ii)	EUR	1.700.000	1.572.840	0,18
Eurofins Scientific SE, 0,875 %, 19.05.31 (i)	EUR	2.600.000	2.112.838	0,25
Highland Holdings Sarl, 0,318 %, 15.12.26 (i)	EUR	1.380.000	1.271.902	0,15
John Deere Bank SA, 2,500 %, 14.09.26 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.372.563	0,28
Medtronic Global Holdings SCA, 1,125 %, 07.03.27 (i)	EUR	5.320.000	5.027.368	0,59
Medtronic Global Holdings SCA, 1,500 %, 02.07.39 (i)	EUR	3.100.000	2.364.556	0,28
Medtronic Global Holdings SCA, 1,625 %, 07.03.31 (i)	EUR	1.400.000	1.269.086	0,15
Novartis Finance SA, Zero Coupon Bond, 23.09.28 (i)	EUR	2.445.000	2.162.153	0,25
Prologis International Funding II SA 2,375 %, 14.11.30 (i)	EUR	1.450.000	1.332.625	0,16
Prologis International Funding II SA 3,625 %, 07.03.30 EMTN (i)	EUR	1.900.000	1.884.298	0,22
SEGRO Capital Sarl, 0,500 %, 22.09.31 (i)	EUR	2.275.000	1.783.600	0,21
SES SA, 5,625 % (i) (ii) (iii)	EUR	3.635.000	3.629.475	0,42
			37.082.417	4,32
Niederlande - 13,99 % (31. Dezember 2022: 18,90 %)				
ABN AMRO Bank NV, 0,500 %, 23.09.29 EMTN (i)	EUR	4.100.000	3.481.023	0,41
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, 22.02.33 EMTN (i) (ii)	EUR	1.500.000	1.542.435	0,18
Alliander NV, 3,250 %, 13.06.28 EMTN (i)	EUR	4.240.000	4.322.417	0,50
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 1,125 %, 17.09.25 (i)	EUR	5.100.000	4.917.420	0,57
Argentum Netherlands BV for Givaudan SA, 2,000 %, 17.09.30 (i)	EUR	2.200.000	2.076.039	0,24
Argentum Netherlands BV for Zurich Insurance Co Ltd., 2,750 %, 19.02.49 (i) (ii)	EUR	1.365.000	1.278.705	0,15
ASR Nederland NV, 3,375 %, 02.05.49 (i) (ii)	EUR	600.000	556.283	0,06
ASR Nederland NV, 5,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	550.000	549.373	0,06
ASR Nederland NV, 7,000 %, 07.12.43 (i) (ii)	EUR	675.000	760.120	0,09
Citycon Treasury BV, 2,375 %, 15.01.27 EMTN (i)	EUR	2.335.000	2.038.240	0,24
Coca-Cola HBC Finance BV, 0,625 %, 21.11.29 (i)	EUR	2.115.000	1.829.883	0,21
Compass Group Finance Netherlands BV, 3,000 %, 08.03.30 EMTN (i)	EUR	4.560.000	4.538.386	0,53

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Niederlande - 13,99 % (31. Dezember 2022: 18,90 %) (Fortsetzung)				
CTP NV, 1,500 %, 27.09.31 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.005.844	0,12
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19.06.26 EMTN (i)	EUR	900.000	914.857	0,11
Daimler Truck International Finance BV, 3,875 %, 19.06.29 EMTN (i)	EUR	3.300.000	3.407.356	0,40
de Volksbank NV, 1,750 %, 22.10.30 EMTN (i) (ii)	EUR	1.400.000	1.316.952	0,15
easyJet FinCo BV, 1,875 %, 03.03.28 EMTN (i)	EUR	2.000.000	1.866.932	0,22
ELM BV for Firmenich International SA, 3,750 % (i) (ii) (iii)	EUR	2.925.000	2.863.283	0,33
ELM BV for Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG, 3,375 %, 29.09.47 (i) (ii)	EUR	1.465.000	1.395.313	0,16
Essity Capital BV, 3,000 %, 21.09.26 EMTN (i)	EUR	1.390.000	1.385.427	0,16
Euronext NV, 1,000 %, 18.04.25 (i)	EUR	4.005.000	3.867.693	0,45
Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, 29.03.30 EMTN (i)	EUR	1.840.000	1.696.811	0,20
Iberdrola International BV, 1,450 % (i) (ii) (iii)	EUR	1.900.000	1.726.625	0,20
Iberdrola International BV, 1,874 % (i) (ii) (iii)	EUR	3.400.000	3.200.250	0,37
IMCD NV, 4,875 %, 18.09.28 (i)	EUR	1.365.000	1.430.598	0,17
ING Groep NV, 0,250 %, 18.02.29 (i) (ii)	EUR	6.600.000	5.724.022	0,67
ING Groep NV, 1,250 %, 16.02.27 EMTN (i) (ii)	EUR	2.700.000	2.568.031	0,30
ING Groep NV, 1,625 %, 26.09.29 EMTN (i) (ii)	EUR	1.700.000	1.657.211	0,19
ING Groep NV, 2,500 %, 15.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	2.100.000	2.093.923	0,24
JAB Holdings BV, 5,000 %, 12.06.33 (i)	EUR	1.300.000	1.400.437	0,16
Koninklijke Ahold Delhaize NV, 0,375 %, 18.03.30 (i)	EUR	4.095.000	3.465.648	0,40
Lseg Netherlands BV, 4,125 %, 29.09.26 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.488.654	0,41
Nederlandse Gasunie NV, 0,375 %, 03.10.31 EMTN (i)	EUR	420.000	343.566	0,04
Nederlandse Gasunie NV, 3,375 %, 11.07.34 EMTN (i)	EUR	2.680.000	2.734.232	0,32
NN Group NV, 4,375 % EMTN (i) (ii) (iii)	EUR	132.000	131.178	0,02
NN Group NV, 4,625 %, 13.01.48 EMTN (i) (ii)	EUR	830.000	832.075	0,10
NN Group NV, 5,250 %, 03.01.43 EMTN (i) (ii)	EUR	820.000	837.027	0,10
PACCAR Financial Europe BV, Zero Coupon Bond, 01.03.26 EMTN (i)	EUR	2.250.000	2.102.207	0,24
Prosus NV, 2,085 %, 19.01.30 (i)	EUR	1.480.000	1.234.498	0,14
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 2,750 %, 09.09.30 EMTN (i)	EUR	3.200.000	3.184.256	0,37
Sika Capital BV, 3,750 %, 03.11.26 (i)	EUR	1.695.000	1.723.799	0,20
Sika Capital BV, 3,750 %, 03.05.30 (i)	EUR	2.635.000	2.715.090	0,32
Stedin Holding NV, 0,875 %, 24.10.25 EMTN (i)	EUR	4.185.000	4.008.707	0,47
Stedin Holding NV, 2,375 %, 03.06.30 EMTN (i)	EUR	3.055.000	2.910.187	0,34
Stellantis NV, 4,250 %, 16.06.31 EMTN (i)	EUR	2.365.000	2.451.743	0,29
Telefonica Europe BV, 3,875 % (i) (ii) (iii)	EUR	2.600.000	2.513.654	0,29
TenneT Holding BV, 1,375 %, 26.06.29 EMTN (i)	EUR	2.295.000	2.167.627	0,25
TenneT Holding BV, 1,500 %, 03.06.39 EMTN (i)	EUR	475.000	411.768	0,05
TenneT Holding BV, 4,500 %, 28.10.34 EMTN (i)	EUR	1.600.000	1.772.582	0,21
TenneT Holding BV, 4,750 %, 28.10.42 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.494.909	0,17
Thermo Fisher Scientific Finance I BV, 2,000 %, 18.10.51 (i)	EUR	1.900.000	1.357.873	0,16
Vesteda Finance BV, 0,750 %, 18.10.31 EMTN (i)	EUR	1.600.000	1.282.826	0,15
Vesteda Finance BV, 2,000 %, 10.07.26 EMTN (i)	EUR	3.655.000	3.512.345	0,41
Vonovia Finance BV, 2,125 %, 22.03.30 EMTN (i)	EUR	1.300.000	1.161.862	0,14
Vonovia Finance BV, 2,250 %, 07.04.30 (i)	EUR	1.900.000	1.706.557	0,20
WPC Eurobond BV, 0,950 %, 01.06.30 (i)	EUR	2.460.000	2.042.046	0,24

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Niederlande - 13,99 % (31. Dezember 2022: 18,90 %) (Fortsetzung)				
WPC Eurobond BV, 2,250 %, 19.07.24 (i)	EUR	1.035.000	1.021.855	0,12
			120.020.660	13,99
Neuseeland - 0,57 % (31. Dezember 2022: 1,06 %)				
ANZ New Zealand Int'l Ltd, 0,200 %, 23.09.27 EMTN (i)	EUR	3.795.000	3.392.191	0,40
ASB Bank Ltd, 4,500 %, 16.03.27 EMTN (ii)	EUR	1.430.000	1.476.618	0,17
			4.868.809	0,57
Norwegen - 2,39 % (31. Dezember 2022: 3,20 %)				
DNB Bank ASA, 0,250 %, 23.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	4.815.000	4.221.262	0,49
DNB Bank ASA, 0,375 %, 18.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	1.900.000	1.740.545	0,20
Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 25.02.25 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.630.751	0,19
Santander Consumer Bank AS, 0,500 %, 11.08.25 EMTN (i)	EUR	2.700.000	2.566.080	0,30
Statkraft AS, 1,500 %, 26.03.30 EMTN (i)	EUR	3.730.000	3.422.454	0,40
Statnett SF, 0,875 %, 08.03.25 EMTN (i)	EUR	1.845.000	1.787.919	0,21
Statnett SF, 1,250 %, 26.04.30 EMTN (i)	EUR	2.547.000	2.307.703	0,27
Telenor ASA, 0,750 %, 31.05.26 EMTN (i)	EUR	2.975.000	2.815.362	0,33
			20.492.076	2,39
Spanien - 3,88 % (31. Dezember 2022: 3,33 %)				
Aena SME SA, 4,250 %, 13.10.30 EMTN (i)	EUR	1.500.000	1.595.773	0,19
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,125 %, 24.03.27 EMTN (i) (ii)	EUR	3.100.000	2.885.550	0,34
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, 02.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	1.800.000	1.857.852	0,22
Banco de Sabadell SA, 5,500 %, 09.08.29 EMTN (i) (ii)	EUR	1.600.000	1.663.440	0,19
Banco Santander SA, 0,500 %, 24.03.27 EMTN (i) (ii)	EUR	3.200.000	2.984.282	0,35
Banco Santander SA, 3,875 %, 16.01.28 EMTN (i)	EUR	2.200.000	2.252.184	0,26
Banco Santander SA, 4,875 %, 18.10.31 EMTN (i)	EUR	2.500.000	2.662.463	0,31
Banco Santander SA, 5,750 %, 23.08.33 EMTN (i) (ii)	EUR	1.400.000	1.468.133	0,17
CaixaBank SA, 0,375 %, 18.11.26 EMTN (i) (ii)	EUR	1.400.000	1.316.812	0,15
CaixaBank SA, 0,625 %, 21.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	3.600.000	3.319.956	0,39
CaixaBank SA, 2,250 %, 17.04.30 EMTN (i) (ii)	EUR	1.900.000	1.833.861	0,21
CaixaBank SA, 3,750 %, 15.02.29 EMTN (i) (ii)	EUR	1.300.000	1.298.050	0,15
CaixaBank SA, 4,250 %, 06.09.30 EMTN (i)	EUR	2.100.000	2.179.590	0,25
CaixaBank SA, 5,000 %, 19.07.29 EMTN (i) (ii)	EUR	2.000.000	2.090.636	0,24
Mapfre SA, 2,875 %, 13.04.30 (i)	EUR	700.000	639.414	0,08
Telefonica Emisiones SA, 2,318 %, 17.10.28 EMTN (i)	EUR	3.400.000	3.276.682	0,38
			33.324.678	3,88
Schweden - 3,82 % (31. Dezember 2022: 3,16 %)				
EQT AB, 2,375 %, 06.04.28 (i)	EUR	1.630.000	1.536.880	0,18
Investor AB, 1,500 %, 12.09.30 EMTN (i)	EUR	2.900.000	2.634.679	0,31
Molnlycke Holding AB, 0,875 %, 05.09.29 EMTN (i)	EUR	1.400.000	1.205.694	0,14
Molnlycke Holding AB, 4,250 %, 08.09.28 EMTN (i)	EUR	2.440.000	2.506.392	0,29
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 1,750 %, 11.11.26 EMTN (i)	EUR	2.220.000	2.132.235	0,25
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 4,125 %, 29.06.27 EMTN (i)	EUR	2.405.000	2.477.836	0,29
Svenska Handelsbanken AB, 3,375 %, 17.02.28 (i)	EUR	1.100.000	1.109.825	0,13
Swedbank AB, 1,300 %, 17.02.27 EMTN (i)	EUR	4.925.000	4.583.707	0,53
Swedbank AB, 3,625 %, 23.08.32 EMTN (i) (ii)	EUR	1.400.000	1.369.358	0,16
Swedbank AB, 4,125 %, 13.11.28 EMTN (i)	EUR	2.250.000	2.331.073	0,27
Vattenfall AB, 0,125 %, 12.02.29 EMTN (i)	EUR	1.485.000	1.284.249	0,15
Vattenfall AB, 3,750 %, 18.10.26 EMTN (i)	EUR	4.290.000	4.360.588	0,51
Volvo Treasury AB, 3,625 %, 25.05.27 EMTN (i)	EUR	3.015.000	3.067.548	0,36

Vermögensaufstellung **Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Schweden – 3,82 % (31. Dezember 2022: 3,16 %) (Fortsetzung)				
Volvo Treasury AB, 3,875 %, 29.08.26 EMTN (i)	EUR	2.100.000	2.140.377	0,25
			32.740.441	3,82
Schweiz - 2,20 % (31. Dezember 2022: 2,24 %)				
Credit Suisse AG, 5,500 %, 20.08.26 EMTN (i)	EUR	4.820.000	5.067.412	0,59
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft, 4,840 %, 03.11.28 EMTN (i)	EUR	1.700.000	1.775.792	0,21
UBS AG, 0,500 %, 31.03.31 EMTN (i)	EUR	1.965.000	1.605.599	0,19
UBS Group AG, 0,250%, 03.11.26 (i) (ii)	EUR	4.020.000	3.769.104	0,44
UBS Group AG, 0,625 %, 18.01.33 EMTN (i)	EUR	2.420.000	1.824.908	0,21
UBS Group AG, 0,650 %, 14.01.28 EMTN (i) (ii)	EUR	5.245.000	4.791.298	0,56
			18.834.113	2,20
Vereinigtes Königreich - 7,64 % (31. Dezember 2022: 7,10 %)				
AstraZeneca PLC, 0,375 %, 03.06.29 EMTN (i)	EUR	2.530.000	2.225.839	0,26
AstraZeneca PLC, 3,750 %, 03.03.32 EMTN (i)	EUR	2.400.000	2.524.680	0,29
Brambles Finance PLC, 4,250 %, 22.03.31 EMTN (i)	EUR	1.360.000	1.434.221	0,17
Chanel Ceres PLC, 0,500 %, 31.07.26 (i)	EUR	2.685.000	2.496.427	0,29
Chanel Ceres PLC, 1,000 %, 31.07.31 (i)	EUR	3.020.000	2.534.475	0,30
Coca-Cola Europacific Partners PLC, 1,875 %, 18.03.30 (i)	EUR	2.180.000	2.022.473	0,24
DS Smith PLC, 0,875 %, 12.09.26 EMTN (i)	EUR	2.065.000	1.926.426	0,22
DS Smith PLC, 4,500 %, 27.07.30 EMTN (i)	EUR	2.080.000	2.165.721	0,25
GlaxoSmithKline Capital PLC, 1,375 %, 12.09.29 (i)	EUR	1.400.000	1.296.638	0,15
HSBC Holdings PLC, 3,019 %, 15.06.27 (i) (ii)	EUR	2.425.000	2.395.272	0,28
HSBC Holdings PLC, 4,787 %, 10.03.32 EMTN (i) (ii)	EUR	2.600.000	2.747.888	0,32
HSBC Holdings PLC, 6,364 %, 16.11.32 (i) (ii)	EUR	1.215.000	1.306.198	0,15
International Distributions Services PLC, 5,250 %, 14.09.28 (i)	EUR	2.195.000	2.278.652	0,27
National Gas Transmission PLC, 4,250 %, 05.04.30 EMTN (i)	EUR	1.625.000	1.687.214	0,20
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC, 3,530 %, 20.09.28 EMTN (i)	EUR	6.280.000	6.372.417	0,74
Nationwide Building Society, 4,500 %, 01.11.26 EMTN (i)	EUR	4.300.000	4.433.988	0,52
NatWest Group PLC, 1,750 %, 02.03.26 EMTN (i) (ii)	EUR	6.140.000	5.976.651	0,70
Reckitt Benckiser Treasury Services PLC, 3,875 %, 14.09.33 EMTN (i)	EUR	3.915.000	4.148.019	0,48
SSE PLC, 2,875 %, 01.08.29 EMTN (i)	EUR	2.205.000	2.180.348	0,25
SSE PLC, 4,000 % (i) (ii) (iii)	EUR	1.750.000	1.693.283	0,20
Standard Chartered PLC, 1,200 %, 23.09.31 EMTN (i) (ii)	EUR	2.650.000	2.400.635	0,28
Standard Chartered PLC, 1,625 %, 03.10.27 EMTN (i) (ii)	EUR	5.000.000	4.736.050	0,55
Vodafone Group PLC, 1,625 %, 24.11.30 EMTN (i)	EUR	4.990.000	4.524.563	0,53
			65.508.078	7,64
Vereinigte Staaten - 16,89 % (31. Dezember 2022: 16,48 %)				
AbbVie Inc, 2,125 %, 17.11.28	EUR	2.000.000	1.926.440	0,22
American Tower Corp, 0,400 %, 15.02.27	EUR	2.240.000	2.040.259	0,24
American Tower Corp, 0,450 %, 15.01.27	EUR	3.920.000	3.584.605	0,42
American Tower Corp, 0,875 %, 21.05.29	EUR	1.765.000	1.537.784	0,18
AT&T Inc, 1.600 %, 19.05.28	EUR	9.085.000	8.524.495	0,99
AT&T Inc, 4,300 %, 18.11.34	EUR	3.005.000	3.173.761	0,37
Bank of America Corp, 1,381 %, 09.05.30 EMTN (ii)	EUR	4.290.000	3.833.278	0,45
Bank of America Corp, 1,662 %, 25.04.28 EMTN (ii)	EUR	4.410.000	4.167.009	0,49
Bank of America Corp, 1,776 %, 04.05.27 EMTN (ii)	EUR	4.100.000	3.936.295	0,46
Becton Dickinson & Co, 1,900 %, 15.12.26	EUR	2.100.000	2.028.037	0,24
BMW US Capital LLC, 1,000 %, 20.04.27 EMTN	EUR	3.931.000	3.706.391	0,43

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	Zeitwert EUR	% des Nettovermögens
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten – 16,89 % (31. Dezember 2022: 16,48 %) (Fortsetzung)				
Booking Holdings Inc, 4,250 %, 15.05.29	EUR	3.070.000	3.247.890	0,38
Carrier Global Corp, 4,375 %, 29.05.25	EUR	2.015.000	2.032.008	0,24
Carrier Global Corp, 4,500 %, 29.11.32	EUR	1.335.000	1.428.925	0,17
Caterpillar Financial Services Corp, 3,742 %, 04.09.26 EMTN	EUR	2.445.000	2.493.455	0,29
Chubb INA Holdings Inc, 1,400 %, 15.06.31	EUR	4.935.000	4.342.678	0,51
Chubb INA Holdings Inc, 1,550 %, 15.03.28	EUR	500.000	471.345	0,05
Citigroup Inc, 1,500 %, 24.07.26 EMTN (ii)	EUR	2.335.000	2.253.480	0,26
Citigroup Inc, 2,125 %, 10.09.26 EMTN	EUR	2.320.000	2.233.334	0,26
Coca-Cola Co, 0,400 %, 06.05.30	EUR	5.400.000	4.638.352	0,54
Eli Lilly & Co, 1,125 %, 14.09.51	EUR	800.000	519.643	0,06
FedEx Corp, 1,625 %, 11.01.27	EUR	1.690.000	1.616.335	0,19
Fiserv Inc, 4,500 %, 24.05.31	EUR	4.200.000	4.449.396	0,52
General Mills Inc, 3,907 %, 13.04.29	EUR	3.160.000	3.260.592	0,38
General Motors Financial Co Inc, 4,500 %, 22.11.27 EMTN	EUR	1.100.000	1.139.382	0,13
Illinois Tool Works Inc, 0,625 %, 05.12.27	EUR	1.885.000	1.734.049	0,20
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, 24.02.28 EMTN (ii)	EUR	3.815.000	3.473.153	0,40
JPMorgan Chase & Co, 1,001 %, 25.07.31 EMTN (ii)	EUR	5.005.000	4.268.169	0,50
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25.05.28	EUR	3.300.000	3.187.434	0,37
Merck & Co Inc, 0,500 %, 02.11.24	EUR	1.350.000	1.313.977	0,15
Morgan Stanley, 0,406 %, 29.10.27 (ii)	EUR	1.565.000	1.436.435	0,17
Morgan Stanley, 4,656 %, 02.03.29 (ii)	EUR	6.140.000	6.377.157	0,74
Nasdaq Inc, 0,900 %, 30.07.33	EUR	2.375.000	1.880.656	0,22
National Grid North America Inc, 4,668 %, 12.09.33 EMTN	EUR	1.735.000	1.852.267	0,22
Netflix Inc, 4,625 %, 15.05.29	EUR	3.685.000	3.931.827	0,46
PepsiCo Inc, 0,500 %, 06.05.28 EMTN	EUR	4.120.000	3.748.030	0,44
PPG Industries Inc, 1,400 %, 13.03.27	EUR	250.000	235.543	0,03
PPG Industries Inc, 2,750 %, 01.06.29	EUR	2.555.000	2.495.816	0,29
Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, 08.02.29 EMTN	EUR	5.540.000	4.913.404	0,57
Tapestry Inc, 5,375 %, 27.11.27	EUR	955.000	989.720	0,12
Tapestry Inc 5,875 %, 27.11.31	EUR	855.000	899.171	0,10
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,875 %, 01.10.31	EUR	4.840.000	4.129.585	0,48
Thermo Fisher Scientific Inc, 2,000 %, 15.04.25	EUR	2.100.000	2.056.639	0,24
Toyota Motor Credit Corp, 3,850 %, 24.07.30 EMTN	EUR	1.350.000	1.403.644	0,16
Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13.09.29 EMTN	EUR	4.240.000	4.448.171	0,52
Unilever Capital Corp, 3,300 %, 06.06.29 EMTN	EUR	1.150.000	1.176.112	0,14
Unilever Capital Corp, 3,400 %, 06.06.33 EMTN	EUR	2.845.000	2.928.330	0,34
Verizon Communications Inc, 0,375 %, 22.03.29	EUR	2.010.000	1.746.200	0,20
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31.10.30	EUR	6.575.000	6.967.052	0,81

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND (Fortsetzung)

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

		Nennwert	**Zeitwert EUR**	**% des Nettovermögens**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN (Fortsetzung)				
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten – 16,89 % (31. Dezember 2022: 16,48 %) (Fortsetzung)				
Visa Inc, 1,500 %, 15.06.26	EUR	4.855.000	4.689.590	0,55
			144.867.300	16,89
NICHT WANDELBARE ANLEIHEN, GESAMT			**841.442.328**	**98,10**
ANLEIHEN UND SCHULDVERSCHREIBUNGEN, GESAMT			**841.442.328**	**98,10**
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE OHNE FINANZDERIVATE, GESAMT (Kosten: EUR 817.600.118)			**841.442.328**	**98,10**

FINANZDERIVATE – 0,00 % (31. Dezember 2022: (0,20 %))

Futures - 0,00 % (31. Dezember 2022: (0,20 %))

Anzahl Kontrakte	**Beschreibung**	**Kontrahent**	**Engagement**	**Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)**	**% des Nettovermögens**
(784)	Euro-Bobl March 2024 Futures	JP Morgan	92.221.920	(1.293.600)	(0,15 %)
316	Euro-Bund March 2024 Futures	JP Morgan	42.264.160	1.097.360	0,13 %
535	Euro-Schatz March 2024 Futures	JP Morgan	56.817.000	184.575	0,02 %
Nicht realisierter Gewinn aus Futures				1.281.935	0,15 %
Nicht realisierter Verlust aus Futures				(1.293.600)	(0,15 %)
Nicht realisierter Nettoverlust aus Futures				**(11.665)**	**(0,00 %)**

	Zeitwert USD	**% des Nettovermögens**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte, gesamt	**842.724.263**	**98,25**
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten, gesamt	**(1.293.600)**	**(0,15)**
		0,00
ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE SOWIE FINANZDERIVATE, GESAMT	**841.430.663**	**98,10**
Bankguthaben	6.508.490	0,76
Sonstige Vermögenswerte	12.871.251	1,50
Abzüglich sonstiger Verbindlichkeiten	(3.098.626)	(0,36)
AUF RÜCKZAHLBARE, GEWINNBERECHTIGTE ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN	**857.711.778**	**100,00**

Vermögensaufstellung	**Zum 31. Dezember 2023**

ZEHN GRÖSSTE BETEILIGUNGEN NACH SEKTOREN ZUM 31. Dezember 2023 IN PROZENT DES NETTOVERMÖGENS

Banken	32,27 %
Elektro	9,63 %
Telekommunikation	4,72 %
Autos	4,21 %
Versicherung	4,06 %
Real Estate Investment Trusts	3,63 %
Gesundheit	3,61 %
Pharmawerte	3,10 %
Real Estate	3,02 %
Finanz-	2,76 %

(i) Wertpapiere, die von Nicht-US- oder nicht kanadischen Emittenten begeben werden.
(ii) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zins entspricht dem am 31. Dezember 2023 gültigen Zinssatz.
(iii) Ewige Anleihen.

Abkürzungen:

EUR: Euro

Analyse des Gesamtvermögens	**% des Gesamtvermögen**
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an offiziellen Börsen notiert sind	97,75
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem geregelten Markt gehandelt werden	0,15
Finanzderivate	(0,15)
Umlaufvermögen	2,25
	100,00

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft)

Größte Zugänge	Nominal USD	Kosten in USD
United States Treasury Note/Bond, 4,625%, 30.06.25	68.420.000,00	68.093.935,94
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27.04.23	29.850.000,00	29.543.973,38
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 15.08.43	18.185.000,00	16.923.415,63
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20.06.23	8.895.000,00	8.833.282,89
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27.06.23	8.830.000,00	8.762.352,40
Aker BP ASA, 6,000 %, 13.06.33 144A	9.005.000,00	8.699.280,25
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20.06.24	8.430.000,00	8.219.819,73
T-Mobile USA Inc, 5,750 %, 15.01.34	6.480.000,00	6.349.041,00
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 01.06.34	6.165.000,00	6.112.474,20
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital, 6,384 %, 23.10.35	6.430.000,00	6.093.148,65
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 23.05.23	5.735.000,00	5.698.964,13
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 12.07.23	5.850.000,00	5.696.712,78
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 23.05.24	5.600.000,00	5.455.959,37
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 06.07.34 144A	5.395.000,00	5.216.587,35
Cemex SAB de CV, Zero Coupon Bond, 14.06.72 144A	4.950.000,00	5.172.750,00
Anglo American Capital PLC, 5,500 %, 02.05.33 144A	5.495.000,00	5.170.647,45
Equinix Inc, 3,900 %, 15.04.32	5.695.000,00	4.876.913,25
Barclays PLC, Zero Coupon Bond, 27.06.34	4.965.000,00	4.796.885,10
Micron Technology Inc, 5,875%, 9/15/33	4.690.000,00	4.666.784,50
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, 15.08.53	4.820.000,00	4.351.556,25
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 28.12.23	4.385.000,00	4.268.967,66
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 24.10.23	4.340.000,00	4.267.155,03
Astrazeneca Finance LLC, 4,875 %, 03.03.28	4.195.000,00	4.186.526,10
Crown Castle Inc, 5,100 %, 01.05.33	4.170.000,00	4.010.178,60
Marvell Technology Inc, 5,950 %, 15.09.33	4.020.000,00	3.952.705,20

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal USD	Erlöse in USD
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, 30.11.23	35.535.000,00	34.829.852,34
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 02.02.23	29.000.000,00	28.929.550,54
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, 29.02.24	23.365.000,00	22.764.446,48
United States Treasury Note/Bond, 4,625%, 30.06.25	21.755.000,00	21.583.659,20
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, 15.05.42	20.625.000,00	16.387.207,03
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, 31.10.23	12.280.000,00	12.082.368,75
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, 15.05.52	9.020.000,00	7.725.973,83
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 27.04.23	6.925.000,00	6.887.306,34
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 04.02.32	7.775.000,00	6.101.975,50
Goldman Sachs Group Inc, Zero Coupon Bond, 23.08.28	6.095.000,00	5.762.273,95
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 12.07.23	5.850.000,00	5.753.777,59
T-Mobile USA Inc, 3.875 %, 15.04.30	6.040.000,00	5.353.856,00
Aker BP ASA, 4,000 %, 15.01.31 144A	6.210.000,00	5.337.184,50
Equinix Inc, 2,500 %, 15.05.31	6.280.000,00	4.913.158,00
Equinix Inc, 3,900 %, 15.04.32	5.695.000,00	4.868.142,95
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 18.02.36 144A	6.415.000,00	4.857.887,05
Barclays PLC, Zero Coupon Bond, 23.09.35	6.145.000,00	4.758.995,25
Anglo American Capital plc, 2,875 %, 17.03.31 144A	5.650.000,00	4.493.897,00
Cemex SAB de CV, 3,875 %, 11.07.31 144A	5.225.000,00	4.362.875,00
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 28.12.23	4.385.000,00	4.311.752,23
Svenska Handelsbanken AB, 0,550 %, 11.06.24 144A	4.515.000,00	4.294.758,30
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 6,500 %, 20.06.27 144A	4.335.000,00	4.291.650,00
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 24.10.23	4.340.000,00	4.290.050,01
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 03.09.23	4.250.000,00	4.241.152,82
Astrazeneca Finance LLC, 4,875 %, 03.03.28	4.195.000,00	4.218.053,80
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, 15.05.50	8.830.000,00	4.134.923,44
DISH Network Corp, 2,375 %, 15.03.24	4.275.000,00	4.066.593,75
Crown Castle Inc, 2,500 %, 15.07.31	4.870.000,00	3.927.947,20
Crown Castle Inc, 5,100 %, 01.05.33	4.170.000,00	3.872.335,00

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal USD	Kosten in USD
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17.10.23	740.000,00	730.043,26
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30.05.23	225.000,00	223.441,78
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30.03.23	170.000,00	168.365,46
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 01.04.24	150.000,00	147.867,44
CSC Holdings LLC, 3,375 %, 15.02.31 144A	200.000,00	137.640,00
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,250 %, 15.01.34 144A	130.000,00	96.768,75
United States Treasury Note/Bond, 4,625%, 30.06.25	70.000,00	69.517,98
Calpine Corp, 4,500 %, 15.02.28 144A	65.000,00	59.462,50
Rand Parent LLC, 8,500 %, 15.02.30 144A	60.000,00	57.380,10
Ford Motor Co, 4,346 %, 12.08.2026	55.000,00	53.000,20
Star Parent Inc, 9,000 %, 01.10.30 144A	45.000,00	44.943,75
Transocean Poseidon Ltd, 6,875 %, 01.02.27 144A	42.500,00	42.052,76
VICI Properties LP/VICI Note Co Inc, 4,250 %, 01.12.26 144A	45.000,00	41.764,05
Newfold Digital Holdings Group Inc, 11,750 %, 15.10.28 144A	40.000,00	40.000,00
TransDigm Inc, 6,750 %, 15.08.28 144A	40.000,00	40.000,00
Covanta Holding Corp, 4,875 %, 01.12.29 144A	45.000,00	39.027,25
Hilton Domestic Operating Co Inc, 3,625 %, 15.02.32 144A	45.000,00	37.326,25
Energy Transfer LP, Zero Coupon Bond, 15.02.72	40.000,00	37.100,00
Sitio Royalties Operating Partnership LP/Sitio Finance Corp, 7,875 %, 01.11.28 144A	35.000,00	35.050,00
Bausch & Lomb Escrow Corp, 8,375 %, 01.10.28 144A	35.000,00	34.881,25

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES HIGH INCOME FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal USD	Erlöse in USD
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17.10.23	625.000,00	618.218,42
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30.03.23	200.000,00	198.432,83
First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, 01.03.26 144A	200.000,00	190.000,00
SoftBank Group Corp, 4,625 %, 06.07.28	200.000,00	172.500,00
United States Treasury Note/Bond, 0.125 %, 15.12.23	150.000,00	146.644,14
Sprint LLC, 7,625 %, 15.02.25	135.000,00	138.910,65
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30.05.23	90.000,00	89.724,97
Loomis Sayles Asia Bond Plus Fund	10,63	84.998,94
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 5,000 %, 01.02.28 144A	85.000,00	77.895,25
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, 01.10.26	85.000,00	75.767,60
United States Treasury Note/Bond, 4,625%, 30.06.25	70.000,00	69.346,48
Uber Technologies Inc, 4,500 %, 15.08.29 144A	75.000,00	68.319,00
KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC, 4,750 %, 01.06.27 144A	70.000,00	66.821,60
Calpine Corp, 5,125 %, 15.03.28 144A	70.000,00	63.512,50
Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, 15.07.30	55.000,00	62.838,80
Navient Corp, 5,625 %, 01.08.33	85.000,00	62.210,60
Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 5,250 %, 15.05.27	65.000,00	58.614,85
Uber Technologies Inc, 8,000 %, 01.11.26 144A	55.000,00	56.069,40
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 01.04.24	55.000,00	54.815,34
Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, 09.01.30	50.000,00	52.503,00

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal USD	Kosten in USD
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31.01.30	1.905.000,00	1.848.313,87
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 8/15/28	1.655.000,00	1.614.332,32
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17.07.24	855.000,00	911.460,63
Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20.12.25	122.500.000,00	877.683,21
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01.12.50	903.021,74	739.066,86
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, 8/15/32	710.000,00	727.056,87
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, 15.11.33	680.000,00	690.262,88
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 15.09.25	665.000,00	654.063,87
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 31.10.24	590.000,00	591.286,33
Canadian Government Bond, 1,500 %, 01.06.26	845.000,00	590.876,80
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, 2/15/33	515.000,00	547.963,73
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15.02.33	7.418.000.000,00	504.673,81
United Kingdom Gilt, 4,750 %, 07.12.30	380.000,00	493.295,34
UnitedHealth Group Inc, 4,500%, 4/15/33	490.000,00	484.787,45
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 15.02.53	505.000,00	480.070,70
Korea Treasury Bond, 4,250 %, 10.12.32	569.920.000,00	467.867,27
China Development Bank, 3,020 %, 03.06.33	3.200.000,00	459.993,93
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, 30.04.24	445.000,00	440.497,85
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, 15.07.32	471.027,60	424.487,82
Freddie Mac Pool, 4,500 %, 01.05.53	384.272,58	370.582,87
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 8/15/24	350.000,00	370.379,01
European Union, 1,000 %, 06.07.32	420.000,00	366.113,26
Province of Quebec Canada, Zero Coupon Bond, 29.10.30	440.000,00	362.914,55
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, 31.05.28	340.000,00	334.116,41
T-Mobile USA Inc, 5,050 %, 15.07.33	335.000,00	332.866,00
Denmark Government Bond, 2,250 %, 15.11.33	2.480.000,00	327.698,13
Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28.02.31	8.075.000,00	324.778,50
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, 25.05.28	285.000,00	275.834,13
AT&T Inc, 2,250 %, 01.02.32	335.000,00	266.288,75
New South Wales Treasury Corp, 2,000 %, 08.03.33	485.000,00	263.337,15

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES GLOBAL OPPORTUNISTIC BOND FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal USD	Erlöse in USD
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,000 %, 8/15/24	1.815.000,00	1.941.825,37
China Government Bond, 1,990 %, 09.04.25	12.390.000,00	1.799.270,31
United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, 31.05.24	1.835.000,00	1.784.058,40
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, 31.10.24	1.735.000,00	1.724.708,02
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, 8/15/28	1.570.000,00	1.512.735,62
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15.02.41	1.860.000,00	1.359.180,27
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, 31.10.27	1.325.000,00	1.323.829,88
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 31.01.30	1.255.000,00	1.209.765,62
Japan Government Five Year Bond, 0,100 %, 20.12.25	173.250.000,00	1.187.346,80
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, 15.05.51	1.530.000,00	1.108.905,47
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, 8/15/32	1.085.000,00	1.079.734,57
Republic of South Africa Government Bond, 7,000 %, 28.02.31	22.895.000,00	1.064.520,86
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Zero Coupon Bond, 15.02.30	1.110.000,00	1.049.832,75
Fannie Mae-Aces, Zero Coupon Bond, 25.11.27	1.104.247,01	1.031.306,32
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, 15.02.32	1.170.000,00	1.020.214,27
European Investment Bank, 2,375 %, 06.07.23 144A	1.290.000,00	954.283,11
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, 15.09.25	955.000,00	931.981,44
Fannie Mae Pool, 2,000 %, 01.05.51	1.100.335,91	929.322,21
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, 15.07.32	953.998,80	869.039,51
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, 15.08.31	980.000,00	832.540,63
Korea Treasury Bond, 1,375 %, 10.06.30	1.107.340.000,00	764.787,81
Spain Government Bond, 1,300 %, 31.10.26 144A	730.000,00	755.227,83
Japan Government Thirty Year Bond, 0,300 %, 20.06.46	135.850.000,00	739.285,82
Fannie Mae Pool, 3,000 %, 01.11.51	826.110,02	738.196,35
United Kingdom Gilt, 4,750 %, 07.12.30	550.000,00	737.306,43
Freddie Mac Pool, 2,500 %, 01.12.50	892.369,24	722.819,08
Japan Government Thirty Year Bond, 1,700 %, 20.12.43	86.450.000,00	717.064,69
China Government Bond, 3,720 %, 12.04.51	4.410.000,00	698.248,45
China Development Bank, 3,120 %, 13.09.31	4.740.000,00	688.242,79
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 1,350 %, 01.04.30	735.000,00	676.502,14

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal USD	Kosten in USD
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 28.12.23	11.360.000,00	11.212.420,83
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20.04.23	4.100.000,00	4.063.368,62
China Government International Bond, 1,200 %, 21.10.30	4.800.000,00	4.034.116,40
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 15.08.23	3.950.000,00	3.893.715,78
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04.09.24	3.000.000,00	2.947.962,29
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 30.01.24	2.523.000,00	2.511.336,28
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 13.04.23	2.480.000,00	2.457.536,16
Uruguay Government International Bond, 8,250 %, 21.05.31	86.993.000,00	2.030.468,66
Mexican Bonos, 7,750 %, 29.05.31	38.436.700,00	1.991.310,45
Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31.01.30	36.930.400,00	1.824.204,22
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15.09.30	26.555.000.000,00	1.816.421,08
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 15.02.24	1.800.000,00	1.775.278,00
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 05.11.23	1.750.000,00	1.740.308,50
Colombian TES, 7,750 %, 18.09.30	8.922.000.000,00	1.704.391,89
Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15.04.31	7.584.000,00	1.556.736,15
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 17.10.23	1.450.000,00	1.426.609,89
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 11.09.23	1.190.000,00	1.173.996,55
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, 31.12.23	840.000,00	827.758,59
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 31.08.23	820.000,00	804.298,33
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04.06.23	800.000,00	791.404,78

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES ALTERNATIVE RISK PREMIA FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal USD	Erlöse in USD
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 28.12.23	9.170.000,00	9.105.699,65
China Government International Bond, 1,200 %, 21.10.30	4.800.000,00	3.990.640,00
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 20.04.23	3.100.000,00	3.084.981,80
Indonesia Treasury Bond, 7,000 %, 15.09.30	25.645.000.000,00	1.765.150,48
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 15.08.23	1.710.000,00	1.689.784,63
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 03.09.23	1.675.000,00	1.662.614,33
Mexican Bonos, 7,750 %, 29.05.31	29.490.300,00	1.553.999,10
Uruguay Government International Bond, 8,250 %, 21.05.31	61.436.000,00	1.476.278,52
Colombian TES, 7,750 %, 18.09.30	7.350.500.000,00	1.457.503,29
Malaysia Government Bond, 2,632 %, 15.04.31	6.442.000,00	1.312.386,98
Republic of South Africa Government Bond, 8,000 %, 31.01.30	26.403.000,00	1.298.088,33
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 26.01.23	1.300.000,00	1.297.112,07
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 4,700 %, 01.09.30 144A	720.000.000,00	857.962,51
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04.06.23	800.000,00	792.036,11
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 05.11.23	650.000,00	648.410,89
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 04.09.24	635.000,00	624.630,41
Gaci First Investment Co, 4,750 %, 14.02.30	520.000,00	520.000,00
Turkiye Government Bond, 11,700 %, 13.11.30	7.966.000,00	502.505,67
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, 10,000 %, 01.01.31	2.420.000,00	461.268,12
United States Treasury Bill, Zero Coupon Bond, 13.04.23	450.000,00	447.864,40

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal EUR	Kosten in EUR
iliad SA, 2,375 %, 17.06.26	900.000,00	822.333,00
Electricite de France SA, Zero Coupon Bond, 15.03.72	600.000,00	526.046,00
Forvia SE, 2,750 %, 15.02.27	510.000,00	450.225,00
iliad SA, 5,375 %, 14.06.27	400.000,00	396.500,00
Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15.09.25	400.000,00	383.620,00
ZF Europe Finance BV, 2,000 %, 23.02.26	400.000,00	369.951,00
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16.05.27	400.000,00	360.585,00
Abertis Infraestructuras Finance BV, Zero Coupon Bond, 26.04.72	400.000,00	345.000,00
Coty Inc, 3,875 %, 15.04.26	325.000,00	312.637,50
Nexans SA, 5,500 %, 05.04.28	300.000,00	307.140,00
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,875 %, 31.03.27	350.000,00	296.725,00
Nykredit Realkredit AS, Zero Coupon Bond, 29.12.32	300.000,00	296.392,00
Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 19.05.31	300.000,00	287.480,00
Credit Mutuel Arkea SA, Zero Coupon Bond, 25.10.29	300.000,00	287.437,00
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,625 %, 15.10.28	370.000,00	286.948,00
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15.09.29	285.000,00	286.600,00
International Game Technology PLC, 2,375 %, 4/15/28	315.000,00	286.382,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC, 4,500 %, 15.07.28	300.000,00	283.730,00
Banque Federative du Credit Mutuel SA, Zero Coupon Bond, 16.06.32	300.000,00	283.196,00
Deutsche Lufthansa AG, 3,000 %, 29.05.26	300.000,00	279.750,00

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO HIGH YIELD FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal EUR	Erlöse in EUR
iliad SA, 2,375 %, 17.06.26	500.000,00	465.900,00
Abertis Infraestructuras Finance BV, Zero Coupon Bond, 24.02.72	500.000,00	462.000,00
Ford Motor Credit Co LLC, 3,250 %, 15.09.25	400.000,00	387.625,00
iliad SA, 5,375 %, 14.06.27	400.000,00	386.000,00
Electricite de France SA, Zero Coupon Bond, 22.01.72	400.000,00	385.586,00
Ford Motor Credit Co LLC, 1,744 %, 19.07.24	395.000,00	382.941,00
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 16.05.27	400.000,00	382.381,00
Banque Federative du Credit Mutuel SA, Zero Coupon Bond, 16.06.32	400.000,00	379.511,00
ZF Finance GmbH, 2,000 %, 06.05.27	400.000,00	353.000,00
Teollisuuden Voima Oyj, 2,125 %, 04.02.25	325.000,00	314.437,25
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 3,750 %, 09.05.27	350.000,00	314.383,00
HSBC Holdings PLC, Zero Coupon Bond, 16.11.32	300.000,00	313.154,00
Synthomer PLC, 3,875 %, 01.07.25	320.000,00	303.605,00
Nykredit Realkredit AS, Zero Coupon Bond, 29.12.32	300.000,00	299.081,00
Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 19.05.31	300.000,00	294.552,00
Deutsche Lufthansa AG, 2,875 %, 11.02.25	300.000,00	288.750,00
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, 15.09.29	285.000,00	288.492,50
Belden Inc, 3,875 %, 15.03.28	300.000,00	283.710,00
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 09.09.30	300.000,00	283.202,00
ProGroup AG, 3,000 %, 31.03.26	300.000,00	282.986,00

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal EUR	Kosten in EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000 %, 04.01.37	1.870.000,00	2.187.902,30
Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 02.03.29	1.170.000,00	1.177.413,00
Volkswagen Bank GmbH, 2,500 %, 31.07.26	1.200.000,00	1.143.888,00
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04.05.27	1.210.000,00	1.130.954,30
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 12.06.29	1.200.000,00	1.073.208,00
ING Groep NV, Zero Coupon Bond, 18.02.29	1.300.000,00	1.072.508,00
Sika Capital BV, 3,750 %, 03.11.26	1.035.000,00	1.034.263,25
Volkswagen Bank GmbH, 4,625 %, 03.05.31	1.000.000,00	1.010.144,00
Deutsche Börse AG, 3,750 %, 28.09.29	1.000.000,00	994.150,00
Credit Suisse AG/London, 5,500 %, 20.08.26	945.000,00	967.952,20
Vesteda Finance BV, 2,000 %, 10.07.26	1.000.000,00	940.745,00
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,625 %, 03.11.28	1.100.000,00	910.812,00
BMW US Capital LLC, 1,000 %, 20.04.27	950.000,00	874.058,85
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31.10.30	860.000,00	860.843,00
Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2,875 %, 15.01.26	870.000,00	842.012,40
Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05.05.28	820.000,00	815.959,50
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25.05.28	860.000,00	802.196,80
BP Capital Markets BV, 3,773 %, 12.05.30	800.000,00	797.620,00
Orsted AS, 1,500 %, 26.11.29	920.000,00	789.580,80
Permanent TSB Group Holdings PLC, Zero Coupon Bond, 25.04.28	770.000,00	774.849,60

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES EURO CREDIT FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal EUR	Erlöse in EUR
Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 17.02.27	1.300.000,00	1.166.947,00
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 12.06.29	1.200.000,00	1.093.868,40
Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, 31.01.28	1.225.000,00	1.053.765,55
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,250 %, 19.07.28	1.200.000,00	981.587,00
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25.05.28	1.005.000,00	944.242,10
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04.05.27	950.000,00	891.385,00
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 3/23/30	955.000,00	848.552,50
SIX Finance Luxembourg SA, Zero Coupon Bond, 02.12.25	900.000,00	826.538,00
Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05.05.28	820.000,00	821.086,00
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 27.01.28	925.000,00	818.796,00
Credit Suisse AG/London, 0,250 %, 01.09.28	930.000,00	756.489,00
Banco de Sabadell SA, Zero Coupon Bond, 07.11.25	800.000,00	751.856,00
Suez SACA, 4,625 %, 03.11.28	700.000,00	722.960,00
Danaher Corp, 2,500 %, 30.03.30	750.000,00	706.121,70
Electricite de France SA, 4,375 %, 12.10.29	700.000,00	705.321,00
Eurofins Scientific SE, 4,000 %, 06.07.29	720.000,00	704.698,10
Toyota Motor Finance Netherlands BV, Zero Coupon Bond, 27.10.25	765.000,00	703.086,00
Crelan SA, 5,750 %, 26.01.28	700.000,00	702.084,00
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000 %, 04.01.37	590.000,00	699.239,10
Sparebanken Soer Boligkreditt AS, 1,000 %, 06.02.24	700.000,00	691.941,00

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Zugänge	Nominal EUR	Kosten in EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 4.000 %, 04.01.37	9.005.000,00	10.417.202,45
Morgan Stanley, Zero Coupon Bond, 02.03.29	7.480.000,00	7.545.893,90
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04.05.27	8.065.000,00	7.544.952,25
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 12.06.29	7.800.000,00	6.980.236,00
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25.05.28	6.870.000,00	6.418.681,10
Deutsche Börse AG, 3,750 %, 28.09.29	6.400.000,00	6.377.819,00
AT&T Inc, 1.600 %, 19.05.28	7.055.000,00	6.362.546,40
Smurfit Kappa Acquisitions ULC, 2,875 %, 15.01.26	6.380.000,00	6.183.266,50
ING Groep NV, Zero Coupon Bond, 18.02.29	7.300.000,00	6.047.427,00
Credit Suisse AG/London, 5,500 %, 20.08.26	5.745.000,00	5.904.220,00
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,625 %, 03.11.28	6.700.000,00	5.553.508,00
Coca-Cola Co, 1,250 %, 08.03.31	6.270.000,00	5.338.256,85
CaixaBank SA, Zero Coupon Bond, 21.01.28	5.900.000,00	5.252.764,00
APRR SA, 3,125 %, 24.01.30	5.200.000,00	5.033.542,00
Nykredit Realkredit AS, 0,750 %, 20.01.27	5.685.000,00	4.996.752,95
NatWest Group PLC, Zero Coupon Bond, 02.03.26	5.170.000,00	4.985.566,70
HSBC Holdings PLC, Zero Coupon Bond, 15.06.27	5.065.000,00	4.871.828,00
BMW US Capital LLC, 1,000 %, 20.04.27	5.141.000,00	4.768.320,09
Verizon Communications Inc, 4,250 %, 31.10.30	4.745.000,00	4.754.788,10
Toyota Motor Credit Corp, 4,050 %, 13.09.29	4.690.000,00	4.743.221,20

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

LOOMIS SAYLES SUSTAINABLE EURO CREDIT FUND

ENTWICKLUNG DER PORTFOLIOZUSAMMENSETZUNG (ungeprüft) (Fortsetzung)

Größte Abgänge	Nominal EUR	Erlöse in EUR
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 12.06.29	7.800.000,00	7.115.136,00
Coca-Cola Co, 1,250 %, 08.03.31	6.270.000,00	5.274.057,00
JPMorgan Chase & Co, Zero Coupon Bond, 3/23/30	5.870.000,00	5.212.765,00
Nykredit Realkredit AS, 0,750 %, 20.01.27	5.685.000,00	5.113.917,60
Kraft Heinz Foods Co, 2,250 %, 25.05.28	5.170.000,00	4.819.581,00
Nordea Bank Abp, 4,125 %, 05.05.28	4.710.000,00	4.716.008,00
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 0,250 %, 19.07.28	5.400.000,00	4.420.493,00
Stellantis NV, 0,750 %, 18.01.29	5.200.000,00	4.326.363,80
Cooperatieve Rabobank UA, Zero Coupon Bond, 25.04.29	4.200.000,00	4.199.060,00
E.ON SE, 1,625 %, 22.05.29	4.655.000,00	4.189.739,00
Credit Suisse AG/London, 0,250 %, 01.09.28	5.100.000,00	4.169.571,00
ING Groep NV, Zero Coupon Bond, 23.05.26	4.300.000,00	4.141.141,00
Deutsche Bank AG, Zero Coupon Bond, 17.02.27	4.500.000,00	4.043.572,00
Standard Chartered PLC, Zero Coupon Bond, 02.07.27	4.385.000,00	3.965.126,10
Santander Consumer Bank AS, 0,125 %, 11.09.24	4.000.000,00	3.857.600,00
Electricite de France SA, 4,375 %, 12.10.29	3.800.000,00	3.827.488,00
Nationwide Building Society, Zero Coupon Bond, 08.03.26	3.925.000,00	3.782.326,25
Bank of America Corp, Zero Coupon Bond, 04.05.27	3.965.000,00	3.720.359,50
TenneT Holding BV, 2,125 %, 17.11.29	4.025.000,00	3.709.342,50
SELP Finance Sarl, 3,750 %, 10.08.27	3.900.000,00	3.703.495,70

Die Zentralbank von Irland benötigt eine Aufstellung der wesentlichen Änderungen in der Zusammenstellung des Portfolios im Laufe des Geschäftsjahres. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe eines Wertpapiers, die ein Prozent des Gesamtwerts der Käufe im Geschäftsjahr überschreiten, sowie die Gesamtverkäufe, die ein Prozent des Gesamtwerts der Verkäufe überschreiten. Es müssen mindestens die umfangreichsten 20 Käufe und 20 Verkäufe oder, bei weniger als 20 Käufen und Verkäufen, sämtliche Käufe und Verkäufe angegeben werden. Eine vollständige Aufstellung der Portfolioveränderungen im Geschäftsjahr ist auf Anfrage kostenfrei beim Administrator erhältlich.

ANHANG I (ungeprüft)

Vergütungspolitik (ungeprüft)

Vergütungspolitik der Natixis International Funds (Dublin) I PLC

Die Gesellschaft wurde von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) als OGAW-Investmentgesellschaft zugelassen und reguliert.

Der Zweck der Vergütungspolitik besteht darin, die Vergütungspraktiken der Gesellschaft in Bezug auf ihre identifizierten Mitarbeiter, d. h. die nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft (die „Verwaltungsratsmitglieder“), zu beschreiben. Der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) hat diese Praktiken festgelegt, um sicherzustellen, dass sie einem soliden und effektiven Risikomanagement entsprechen und dieses fördern und nicht zum Eingehen von Risiken ermutigen, die mit dem Risikoprofil und der Satzung der Gesellschaft unvereinbar sind.

Die folgenden Fonds werden derzeit von der Gesellschaft verwaltet:

- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Multisector Income Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles High Income Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro High Yield Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro Credit Fund**
- **Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund**

(die „Fonds“).

Das Gesamtnettovermögen der Gesellschaft belief sich zum Ende des letzten Geschäftsjahres (31. Dezember 2023) auf einen Gesamtbetrag von USD 1.721.799.476.

Identifizierte Mitarbeiter

Die Kategorien von Mitarbeitern, einschließlich Geschäftsführung, Risikoträgern und Kontrollfunktionen, deren berufliche Tätigkeiten wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Gesellschaft und der Fonds haben können, sind im Anhang zu dieser Vergütungspolitik aufgeführt (die „identifizierten Mitarbeiter“).

Die einzigen identifizierten Mitarbeiter sind die Verwaltungsratsmitglieder.

Arten von Vergütungen

Diese Vergütungspolitik gilt für alle Formen von Zahlungen oder Leistungen, die von der Gesellschaft an die identifizierten Mitarbeiter im Gegenzug für berufliche Tätigkeiten gezahlt werden. Zahlungen oder Leistungen können wie folgt erfolgen:

1. feste Vergütung (Zahlungen oder Leistungen ohne Bezugnahme auf die Leistung), und

2. variable Vergütung (zusätzliche Zahlungen in Abhängigkeit von der Leistung oder anderen vertraglichen Kriterien wie unten beschrieben).

Die Gesellschaft zahlt feste Vergütungen derzeit nur den unabhängigen, nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitgliedern (Daniel Morrissey und John Nolan).

Verwaltungsratsmitglieder, die auch Mitarbeiter der Natixis Investment Managers Gruppe (Jason Trepanier), Loomis, Sayles & Company, L.P., Portfolioverwalter, (Lynda Wood (geb. Schweitzer)) und Loomis Sayles Investments Limited, UK, eine hundertprozentige Tochtergesellschaft des Portfolioverwalters (Christopher Yiannakou) sind, erhalten keine Vergütung von der Gesellschaft.

Vergütungspolitik

Die Vergütungspolitik der Gesellschaft besteht darin, den relevanten identifizierten Mitarbeitern (im Fall der Gesellschaft nur die unabhängigen, nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder) nur eine feste Vergütung zu zahlen, wobei keine variable Komponente gezahlt wird. Verwaltungsratsmitglieder, die auch Mitarbeiter in der Natixis Investment Managers Gruppe sind, unterliegen der Vergütungspolitik von Natixis Investment Managers International und können auch als „identifizierte Mitarbeiter“ im Rahmen der

ANHANG I (ungeprüft) (Fortsetzung)

Vergütungspolitik (ungeprüft) (Fortsetzung)

Vergütungspolitik (Fortsetzung)

Vergütungspolitik von Natixis Investment Managers SA gelten. Die Vergütungspolitik der Natixis Investment Managers SA finden Sie auf der folgenden Website: www.im.natixis.com/intl-regulatory-documents

Offenlegung

Die Gesellschaft erfüllt die Offenlegungspflichten gemäß den folgenden Dokumenten:

(a) Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in der durch die Richtlinie 2014/91/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. Juli 2014 geänderten Fassung betreffend Verwahrstellenfunktionen, Vergütungsgrundsätzen und Sanktionen, einschließlich ihrer verbindlichen Durchführungverordnungen auf der Ebene der EU oder eines Herkunftsmitgliedstaats in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinie“),

(b) alle von der Europäischen Kommission gemäß oder in Übereinstimmung mit der OGAW-Richtlinie von Zeit zu Zeit erlassenen oder umgesetzten Verordnungen, sei es als delegierte Rechtsakte oder anderweitig,

(c) die Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48 (1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2015 S.I. Nr. 420 von 2015, und

(d) die ESMA-Leitlinien zu soliden Vergütungsgrundsätzen gemäß OGAW-Richtlinie und der gemäß Artikel 14a(4) der OGAW-Richtlinie veröffentlichten AIFMD (die „OGAW-Vergütungsleitlinien“).

Die aktuelle Vergütungspolitik der Gesellschaft finden Sie auf der folgenden Website: www.im.natixis.com/intl-regulatory-documents. Eine zusammenfassende Erklärung in Bezug auf diese Vergütungspolitik wurde in den Prospekt der Gesellschaft und in die einzelnen PRIIPs der Gesellschaft eingefügt.

Der Gesamtbetrag der Vergütung für das Geschäftsjahr, gegebenenfalls unterteilt in feste und variable Vergütung, die von der Gesellschaft an die entsprechenden identifizierten Mitarbeiter gezahlt wurde, wird im Jahresbericht der Gesellschaft angegeben, ebenso wie der Gesamtbetrag der Vergütung, unterteilt nach den Mitgliedern der Geschäftsführung, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil der Gesellschaft haben.

Der Verwaltungsrat ist der Ansicht, dass diese Vergütungspolitik der Strategie, den Zielen und Werten der Gesellschaft und der Fonds entspricht und nicht im Widerspruch zu den besten Interessen der Gesellschaft, der Fonds und ihrer Anleger steht.

Vergütungsausschuss/Aufsichtsrat

Der Verwaltungsrat hat angesichts der Größe, der internen Tätigkeiten, der Art und Komplexität der Gesellschaft beschlossen, dass ein Vergütungsausschuss nicht erforderlich ist. Vergütungsangelegenheiten werden vom Verwaltungsrat behandelt, wobei das jeweils betroffene Verwaltungsratsmitglied bei solchen Gesprächen nicht anwesend ist.

Die Gesellschaft verfügt über eine Richtlinie zu Interessenkonflikten von Verwaltungsratsmitgliedern sowie die Vergütungspolitik, deren Umsetzung den Bestimmungen dieser Richtlinie zu Interessenkonflikten unterliegt.

Anwendung

Es ist die Absicht der Gesellschaft, diese Vergütungspolitik gemäß den OGAW-Vergütungsrichtlinien in ihrer jeweils gültigen Fassung anzuwenden.

Prüfung

Der Verwaltungsrat wird die Umsetzung dieser Vergütungspolitik jährlich überprüfen und seine Praktiken jährlich auf die Einhaltung der Vergütungspolitik überprüfen.

ANHANG I (Ungeprüft) (Fortsetzung)

Vergütungspolitik (ungeprüft) (Fortsetzung)

Geltungsbereich

Diese Vergütungspolitik findet auf die Gesellschaft Anwendung und erstreckt sich nicht auf die Beauftragten der Gesellschaft.

Die Gesellschaft zahlt in Bezug auf jeden Fonds Anlageverwaltungsgebühren an den von der Gesellschaft ernannten Portfolioverwalter, die in den Prospektunterlagen und im Jahresbericht der Gesellschaft angegeben werden. Die Gesellschaft zahlt keine leistungsabhängigen Portfolioverwaltungsgebühren.

Bei den nachstehenden Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um die identifizierten Mitarbeiter.

Jason Trepanier
Lynda Wood (geb. Schweitzer)
Christopher Yiannakou

ANHANG II (ungeprüft)

Offenlegung der Vergütungen (ungeprüft)

Offenlegung der Vergütungen der Natixis Investment Managers S.A. in ihrer Eigenschaft als Portfolioverwalter der Natixis International Funds (Dublin) 1 Plc (die „Gesellschaft“)

Natixis Investment Managers S.A. als Portfolioverwalter des Fonds (der „Portfolioverwalter“) hat eine Vergütungsrichtlinie eingeführt, die darauf abzielt, ein solides und effektives Risikomanagement zu fördern und übermäßige Risiken sowohl für den Portfolioverwalter selbst als auch für die von ihm verwalteten Fonds abzuwenden. Die Richtlinie wird auf jährlicher Basis überarbeitet.

Nähere Angaben zur Vergütungspolitik sind auf der Website www.im.natixis.com/intl-regulatory-documents erhältlich. Ein Papierexemplar dieser Angaben ist auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Die folgenden Tabellen zeigen den Anteil der gesamten festen und variablen Vergütung der als „Material Risk Takers“ des Portfolioverwalters und des Portfolioverwalters identifizierten Mitarbeiter an allen von der Gesellschaft verwalteten Fonds.

Die Organisation des Portfolioverwalters erlaubt es nicht, solche Beträge jeweils auf die verwalteten Fonds bezogen zu identifizieren. Die nachfolgenden Zahlen zeigen daher die Höhe der Vergütungen anteilig im Verhältnis zum gesamten verwalteten Vermögen. Der Anteil der Gesamtvergütung, der an identifizierte Mitarbeiter von Unternehmen gezahlt oder zu zahlen ist, an die den Portfolioverwalter Portfoliomanagement-Funktionen übertragen hat (die „Delegierten”), ist ebenfalls im Folgenden aufgeführt.

Die von Natixis Investment Managers, S.A. an ihre als „Material Risk Takers” bezeichneten Mitarbeiter gezahlten Gesamtvergütungen einschließlich der identifizierten Mitarbeiter der Delegierten im zum 31. Dezember 2023 endenden Geschäftsjahr stellen sich wie folgt dar:

Identifizierte Mitarbeiter des Portfolioverwalters

Feste Vergütung	EUR 153.811
Variable Vergütung	EUR 230.008
Summe	EUR 383.819
Anzahl der Begünstigten:	14

Identifizierte Mitarbeiter des bzw. der Delegierten

Feste Vergütung	EUR 545.072
Variable Vergütung	EUR 789.229
Summe	EUR 1.334.301
Anzahl der Begünstigten:	34

Die feste Vergütung umfasst das Grundgehalt 2023 und die variable Vergütung besteht sowohl aus Bar- als auch aus aufgeschobenen Komponenten der Bonusprämien.

ANHANG II (ungeprüft) (Fortsetzung)

Offenlegung der Vergütungen (ungeprüft) (Fortsetzung)

Darüber hinaus ist der Gesamtbetrag der Vergütung für die identifizierten Mitarbeiter des Portfolioverwalters wie folgt weiter unterteilt:

Identifizierte Mitarbeiter des Portfolioverwalters

Vorstand/Geschäftsleitung*	EUR 184.347
Andere Mitarbeiter, die einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Fonds haben	EUR 199.472
Summe	EUR 383.819
Anzahl anderer begünstigter Mitarbeiter:	10

* Vorstand/Geschäftsleitung umfasst:
De Poncharra, Florian
Horsfall, Patricia
Lanne, Christophe
Mouraret, Marine

ANHANG III (ungeprüft)

Angaben zur Wertentwicklung (ungeprüft)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND

Gemäß Abschnitt II, Anhang E „Performance Table“ des Code on Unit Trusts and Mutual Funds:

Angaben zur Wertentwicklung über die letzten zehn Geschäftsjahre; oder, falls der Fonds nicht während dieses gesamten Zeitraums bestand, über den gesamten Zeitraum seines Bestehens, unter Angabe des höchsten Ausgabepreises und des niedrigsten Rücknahmepreises der Anteile/Aktien während eines jeden dieser Jahre.

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse C/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	20,11	21,40
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	18,91	20,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	18,04	21,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	20,77	22,20
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	20,95	22,41
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	21,08	23,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	19,79	24,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	23,52	24,59
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	19,94	24,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	20,15	22,21
Anteilsklasse C/D (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	14,32	15,23
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	12,73	14,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	11,82	13,72
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	13,18	13,91
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	12,78	13,90
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	12,78	13,86
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	11,73	14,14
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	13,65	14,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	11,26	13,80
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	11,09	12,33
Anteilsklasse CT/A (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,83	9,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,89	10,88
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,24	11,29
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,94	11,42
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,22	11,18
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,27	10,21
Anteilsklasse CT/DG (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	9,15	10,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,96	9,98
Anteilsklasse CT/DM (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,83	9,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,88	10,68
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,03	10,90
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,52	10,93
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,71	10,67
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	8,64	9,53
Anteilsklasse F/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	12,27	13,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	11,74	12,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	11,21	13,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	13,01	13,99
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	13,36	14,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	13,44	14,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	12,76	15,74
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	15,30	16,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	13,16	15,79
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	13,42	14,82

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse F/DM (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	9,82	10,44
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	8,64	9,72
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	7,96	9,23
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	8,89	9,36
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	8,59	9,37
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	8,62	9,32
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	7,88	9,51
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	9,17	9,53
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	7,59	9,30
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	7,48	8,30
Anteilsklasse H-I/A (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	19,45	22,70
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	16,13	19,31
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	15,48	18,83
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	16,92	20,74
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	18,25	21,66
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	18,28	19,56
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	14,75	17,99
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	17,47	18,30
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	14,74	17,94
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	14,70	16,19
Anteilsklasse H-I/D (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	16,07	19,06
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	12,79	15,80
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	12,15	14,47
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	12,61	15,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	11,95	14,54
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	11,65	12,33
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,16	10,93
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,51	10,85
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,45	10,52
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,11	9,17
Anteilsklasse H-I/D (GBP)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	21,14	24,52
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	18,13	21,61
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	15,80	19,44
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	15,64	18,33
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	14,64	17,61
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	14,40	16,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	10,28	12,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,82	12,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,65	11,91
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,40	10,52
Anteilsklasse H-N/A (CHF)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	9,95	10,92
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	9,65	11,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,70	10,71
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,78	10,73
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,41	10,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,75	10,68
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,56	9,53
Anteilsklasse H-N/A (EUR)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	11,53	12,12
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	10,67	12,66
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	10,69	11,44
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,63	10,53
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,23	10,71
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,64	10,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,62	9,49

ANHANG III (ungeprüft) (Fortsetzung)

Angaben zur Wertentwicklung (ungeprüft) (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse H-N/D (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	12,22	14,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	9,77	12,01
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	9,27	11,05
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	9,74	11,74
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	9,07	11,03
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	8,93	9,45
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	7,02	8,38
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	8,06	8,32
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	6,50	8,07
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	6,73	7,06
Anteilsklasse H-N1/A (EUR)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019	10,97	11,53
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,70	10,61
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,32	10,82
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,74	10,61
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,73	9,61
Anteilsklasse H-R/A (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	12,62	14,76
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	10,40	12,53
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	9,97	12,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	10,85	13,25
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	11,57	13,80
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	11,59	12,36
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,32	11,33
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,99	11,48
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,18	11,23
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,12	10,04
Anteilsklasse H-R/A (SGD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2014	7,42	8,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	6,49	7,62
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	6,11	7,73
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	7,01	8,09
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	7,44	8,40
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	7,53	8,45
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,66	11,83
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,49	12,05
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,83	11,84
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,88	10,87
Anteilsklasse H-R/D (SGD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2014	7,43	8,29
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	6,28	7,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	5,86	7,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	6,49	7,37
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	6,33	7,30
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	6,37	6,97
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	7,92	9,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	9,15	9,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	7,53	9,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	7,33	8,23
Anteilsklasse H-RE/DM (AUD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	6,84	7,29
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	6,82	7,32
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,76	10,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	10,09	10,47
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,27	10,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,01	9,00

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse H-S/D (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	12,12	14,38
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	9,70	11,91
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	9,20	10,97
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	9,66	11,66
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	9,50	11,55
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,33	9,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	7,34	8,76
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	8,40	8,69
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	6,76	8,42
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	6,50	7,34
Anteilsklasse I/A (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	29,08	31,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	27,97	30,66
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	26,73	31,73
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	31,11	33,51
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	32,15	33,99
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	32,35	36,16
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	28,65	33,92
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	30,62	34,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	31,45	34,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	30,77	32,84
Anteilsklasse I/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	15,27	16,33
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	14,69	16,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	14,04	16,67
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	16,34	17,60
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	16,87	17,85
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	16,98	18,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	16,18	20,00
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	19,45	20,46
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	16,81	20,13
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	17,19	19,00
Anteilsklasse I/D (GBP)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	16,22	17,26
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	14,45	16,19
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	13,43	15,62
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	14,98	15,85
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	14,61	15,81
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	14,53	15,81
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	11,18	12,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,12	11,95
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	11,06	12,29
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	10,28	11,54
Anteilsklasse I/D (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	13,36	14,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	11,85	13,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	10,97	12,76
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	12,23	12,92
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	11,88	12,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	11,85	12,89
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	10,90	13,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	12,67	13,14
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	10,44	12,79
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	10,28	11,43
Anteilsklasse I/DG (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	9,18	10,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,04	10,02
Anteilsklasse N/A (EUR)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	9,73	10,39

ANHANG III (ungeprüft) (Fortsetzung)

Angaben zur Wertentwicklung (ungeprüft) (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse N/A (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,59	10,05
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,65	10,79
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,19	11,36
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,05	11,62
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,55	11,44
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	10,06	10,56
Anteilsklasse N/DM (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	9,85	10,05
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,07	9,89
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2023	8,35	8,82
Anteilsklasse N1/A (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2017	10,00	10,05
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	9,65	10,20
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,71	10,86
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,26	11,46
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,14	11,73
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,65	11,54
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,87	10,91
Anteilsklasse N1/D (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,29	10,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,26	10,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,52	10,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	9,91	10,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,16	10,00
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,03	8,94
Anteilsklasse R/A (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	20,85	22,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	19,86	21,84
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	18,97	22,45
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	21,98	23,59
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	22,47	23,88
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	22,62	25,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	19,90	23,58
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	21,17	23,54
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	21,54	23,51
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	21,02	22,39
Anteilsklasse R/A (SGD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2014	7,69	8,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	7,20	7,92
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	6,88	8,14
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	7,97	8,56
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	8,15	8,66
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	8,21	9,13
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	11,34	12,93
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	12,40	13,25
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	11,19	12,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	11,14	11,83
Anteilsklasse R/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	14,29	15,25
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	13,62	14,97
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	13,00	15,39
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	15,06	16,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	15,41	16,37
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	15,50	17,24
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	14,68	18,08
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	17,56	18,43
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	15,06	18,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	15,33	16,92

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse R/D (EUR)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	9,18	10,08
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	8,72	9,45
Anteilsklasse R/D (GBP)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	21,37	22,73
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	19,12	21,43
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	17,86	20,76
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	19,94	21,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	19,41	21,03
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	19,33	21,00
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	14,87	16,39
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	14,77	15,87
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	14,70	16,32
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	13,65	15,32
Anteilsklasse R/D (SGD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	7,79	8,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	6,80	7,63
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	6,20	7,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	6,90	7,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	6,68	7,27
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	6,68	7,26
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	8,96	10,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	9,53	10,06
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	8,26	9,77
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	7,96	8,46
Anteilsklasse R/D (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	13,35	14,20
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	11,85	13,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	10,98	12,76
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	12,24	12,94
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	11,89	12,91
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	11,87	12,90
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	10,90	13,15
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	12,68	13,16
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	10,45	12,81
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	10,30	11,45
Anteilsklasse R/DG (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2022	9,20	10,22
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,00	10,04
Anteilsklasse R/DM (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	15,31	16,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	13,62	15,32
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	12,69	14,71
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	14,19	14,95
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	13,71	14,97
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	13,76	14,87
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	12,58	15,18
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	14,64	15,21
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	12,13	14,86
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	11,95	13,25
Anteilsklasse RE/A (EUR)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	19,20	20,45
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	18,17	20,02
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	17,34	20,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	20,03	21,45
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	20,34	21,68
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	20,47	22,68
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	17,94	21,25
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	19,02	21,09
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	19,23	21,01
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	18,73	19,96

ANHANG III (ungeprüft) (Fortsetzung)

Angaben zur Wertentwicklung (ungeprüft) (Fortsetzung)

LOOMIS SAYLES MULTISECTOR INCOME FUND (Fortsetzung)

Anteilsklasse	Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil	Höchster Nettoinventarwert je Anteil
Anteilsklasse RE/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	13,59	14,48
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	12,86	14,17
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	12,28	14,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	14,18	15,19
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	14,40	15,35
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	14,49	16,06
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	13,66	16,78
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	16,29	17,06
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	13,89	16,74
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	14,08	15,54
Anteilsklasse RE/D (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,85	9,99
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,91	11,00
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,37	11,51
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,18	11,72
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,54	11,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,70	10,69
Anteilsklasse RE/DM (USD)		
Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2018	9,85	9,99
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	9,91	11,01
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	9,36	11,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,16	11,71
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	9,54	11,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	9,67	10,66
Anteilsklasse S/A (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	14,93	15,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	14,42	15,79
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	13,79	16,39
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	16,09	17,36
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	16,70	17,63
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	16,81	18,85
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	16,08	19,92
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	19,37	20,42
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	16,83	20,10
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	17,26	19,08
Anteilsklasse S/D (GBP)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	16,09	17,12
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	14,33	16,06
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	13,32	15,49
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	14,85	15,79
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	14,56	15,75
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	14,47	15,75
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	11,12	12,28
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	11,07	11,91
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	11,02	12,26
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	10,32	11,53
Anteilsklasse S/D (USD)		
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014	16,10	17,14
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015	14,34	16,07
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2016	13,33	15,50
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2017	14,85	15,71
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018	14,44	15,67
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019	14,39	15,67
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020	13,25	15,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021	15,40	15,98
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022	12,68	15,54
Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023	12,49	13,90

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

ANHANG IV (ungeprüft)

EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (ungeprüft)

Die Verordnung über die Regulierung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Securities Financing Transaction Regulation) („SFT-Verordnung“) hat zur Einführung der Berichtspflicht für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Rate Swaps geführt.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (Securities Financing Transaction, „SFT“) wird gemäß Artikel 3(11) der SFT-Verordnung definiert als:

- ein Repo-Geschäft/Reverse Repo-Geschäft
- Wertpapier- und Warenverleihgeschäfte sowie Wertpapier- und Warenleihgeschäfte
- ein Buy-Sellback-Geschäft oder Sell-Buyback-Geschäft, oder
- ein Lombardgeschäft

Zum 31. Dezember 2023 hielten die Fonds keine Instrumente, die in den Geltungsbereich der SFT-Verordnung fallen.

NATIXIS INTERNATIONAL FUNDS (DUBLIN) I PLC

ANHANG V (ungeprüft)

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft)

Klassifizierung gemäß der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (Offenlegungsverordnung):

Fonds	**Klassifizierung**
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Multisector Income Fund	6
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles High Income Fund	6
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund	8
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Alternative Risk Premia Fund	6
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro High Yield Fund	8
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Euro Credit Fund	8
Natixis International Funds (Dublin) I – Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund	8

Teilfonds gemäß Artikel 6

Die Anlagen, die diesem Finanzprodukte zugrunde liegen, berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für eine ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit.

Teilfonds gemäß Artikel 8

Die folgenden Teilfonds bewerben unter anderem ökologische und/oder soziale Merkmale oder eine Kombination dieser Merkmale, vorausgesetzt, dass die Unternehmen, in die investiert wird, sich an gute Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung halten und als solche in den Geltungsbereich von Artikel 8 der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor fallen: Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund, Loomis Sayles Euro High Yield Fund, Loomis Sayles Euro Credit Fund, Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Loomis Sayles Global Opportunistic Bond Fund
Unternehmenskennung (LEI-Code): GRN8DO5Q28D6Y7RN0D20

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ **Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___%	☐ **Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0 % an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:** ___%	☐ mit einem sozialen Ziel
	☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

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.

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.

Der Portfolioverwalter verwaltete den Fonds im Einklang mit seinem Ziel, das Umweltmerkmal der Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels zu bewerben (das „ökologische Merkmal“).
Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 16 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in ökologische/soziale Merkmale von 10 % auf 50 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und

identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er die Erreichung des ökologischen Merkmals messen wird: 1) die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI) des Fonds muss mindestens 25 % niedriger sein als die des Barclays Global Aggregate Corporate Index, 2) der Fonds muss weniger als 5 % seines NIW in Unternehmensemittenten investiert haben, die im Rahmen des vom Portfolioverwalter erarbeiteten ESG-Rahmens einen zusammengesetzten ESG-Score von 3 erhalten haben, und 3) der Fonds wird nicht in Emittenten investieren, die 10 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Stromerzeugung, dem Abbau oder dem Verkauf von Kraftwerkskohle erzielen. Darüber hinaus investiert der Fonds in Emittenten, die auf die Ziele für eine nachhaltige Entwicklung („SDG“) ausgerichtet sind. Hierzu zählen auch staatliche Emittenten, gemäß definierten Kriterien, die sich auf den Bericht zur nachhaltigen Entwicklung beziehen, als auf ein oder mehrere SDG ausgerichtet gelten.

Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 57 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Aufgrund der oben erwähnten überarbeiteten Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen das ökologische Merkmal bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie oben erwähnt, legte der Portfolioverwalter vom 02.01.23 bis 30.06.23 16 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Von den 16 % wurden 2,7 % des Fonds in grüne Anleihen investiert, bei denen die Verwendung der Erlöse zur Förderung des Klimaschutzes bestätigt wurde. 13,15 % erfüllten den Indikator für die Nutzung erneuerbarer Energien und 0,16 % erfüllten den Indikator für führende Unternehmen beim Klimaschutz.
Am 17.07.23 wurde der Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in ökologische/soziale Merkmale von 10 % auf 50 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er die Erreichung des ökologischen Merkmals messen wird: 1) die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI) des Fonds muss mindestens 25 % niedriger sein als die des Barclays Global Aggregate Corporate Index, 2) der Fonds muss weniger als 5 % seines NIW in Unternehmensemittenten investiert haben, die im Rahmen des vom Portfolioverwalter erarbeiteten ESG-Rahmens einen zusammengesetzten ESG-Score von 3 erhalten haben, und 3) der Fonds wird nicht in Emittenten investieren, die 10 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Stromerzeugung, dem Abbau oder dem Verkauf von Kraftwerkskohle erzielen. Darüber hinaus investiert der Fonds in Emittenten, die auf die Ziele für eine nachhaltige Entwicklung („SDG“) ausgerichtet sind. Hierzu zählen auch staatliche Emittenten, gemäß definierten Kriterien, die sich auf den Bericht zur nachhaltigen Entwicklung beziehen, als auf ein oder mehrere SDG ausgerichtet gelten.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 57 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Von den 57 % waren 19 % des Fonds in Unternehmensanleihen investiert, die die Aufnahmekriterien erfüllten, wozu eine WACI von mindestens 25 % unter dem Referenzindex gehört. 37 % des Fonds waren in Staatsanleihen und Schatzanweisungen investiert, die als auf eines oder mehrere der definierten SDG ausgerichtet gelten. 1 % war in ICMA-zertifizierte grüne Anleihen investiert, deren Verwendung der Erlöse für den Klimaschutz bestätigt wurde (und die nicht bereits in den zuvor erwähnten Unternehmens- und Staatsanleihenbeständen enthalten sind). Des Weiteren erfüllten 16,74 % den Indikator für die Nutzung erneuerbarer Energien. 4,9 % des Fonds waren in grüne Anleihen investiert, bei denen die Verwendung der Erlöse zur Förderung des Klimaschutzes bestätigt wurde. 0,45 %

erfüllten den Indikator für führende Unternehmen beim Klimaschutz. Die WACI des Fonds lag 54,2 % unter der des Barclays Global Aggregate Corporate Index. Der Fonds hielt 0,3 % seines NIW in Unternehmensemittenten, die im Rahmen des vom Portfolioverwalter erarbeiteten ESG-Rahmens einen zusammengesetzten ESG-Score von 3 erhalten haben. Außerdem hielt der Fonds keine Emittenten, die 10 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Stromerzeugung, dem Abbau oder dem Verkauf von Kraftwerkskohle erzielten.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Vom 02.01.23 bis 29.12.23 stiegen die Investitionen des Fonds, die das ökologische Merkmal bewarben, von 16 % (Stand Ende 2022) auf 36 % (basierend auf einem Durchschnitt über 4 Quartale). In diesem Zeitraum sank der prozentuale Anteil des Fonds, der in grüne Anleihen investiert wurde, bei denen die Verwendung der Erlöse zur Förderung des Klimaschutzes bestätigt wurde, von 2,29 % auf 3,84 %. Der Indikator für die Nutzung erneuerbarer Energien stieg von 14 % auf 14,95 %. Der Indikator für führende Unternehmen im Klimaschutz sank von 0,16 % auf 0,36 %. Bitte beachten Sie, dass Anhang II des Fonds am 17. Juli 2023 überarbeitet wurde und die Mindestanlagen des Fonds, die das ökologische Merkmal bewerben, von 10 % auf 50 % erhöht wurden und die Nachhaltigkeitsindikatoren überarbeitet wurden.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.

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:

Nicht zutreffend.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

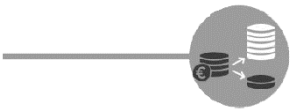
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Berichtszeitraums berücksichtigte der Portfolioverwalter die folgenden wichtigen Indikatoren für nachteilige Auswirkungen bei der Verwaltung des Fonds. Im Folgenden wird besonders darauf hingewiesen, wie die einzelnen Indikatoren behandelt wurden:

- THG-Emissionen (Scope 1, 2): Die PAI lagen bei 92,32 tCO2e bzw. 21,36 tCO2e zum 31.12.23. Diese beiden PAI-Werte waren niedriger als ihre jeweiligen Werte vom 31.12.22.
- CO_2-Bilanz: Der CO_2-Fußabdruck des Fonds betrug zum 31.12.2023 45,32 tCO2e. Im Berichtszeitraum lag dieser Wert unter dem des repräsentativen Index.

- THG-Intensität der Unternehmen, in die investiert wurde: Die WACI des Fonds war zum 31.12.2023 niedriger als zum 31.12.2022. Die WACI-Berechnung beinhaltet nur die Angaben zu Positionen in Unternehmens- und Staatsanleihen.
- THG-Intensität der Länder, in die investiert wurde: Dieser PAI-Wert des Fonds war zum 31.12.2023 niedriger als zum 31.12.2022.
- Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossile Brennstoffe tätig sind: Das Engagement des Fonds in Unternehmen mit Verbindungen zu fossilen Brennstoffen war zum 31.12.2023 niedriger als im Index.
- Anteil des Verbrauchs und der Produktion von nicht erneuerbaren Energien: Der Fonds schloss alle Emittenten aus, die 10 % oder mehr ihrer Einnahmen aus der Stromerzeugung, dem Abbau oder dem Verkauf von Kraftwerkskohle erzielen.
- Intensität des Energieverbrauchs pro Klimasektor mit hoher Auswirkung: Der Fonds verringerte die Intensität des Energieverbrauchs in allen Sektoren mit hoher Auswirkung im Vergleich zum vorherigen Zeitraum.
- Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen): Der Fonds hatte kein Engagement in umstrittenen Waffen.
- Anlagen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen: Der Fonds reduzierte das Engagement in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung von Kohlenstoffemissionen im Vergleich zum Vorjahr.
- Anzahl der identifizierten Fälle schwerer Menschenrechtsverletzungen: Der Fonds verbietet Anlagen in Emittenten, die auf der „Fail-Liste“ des UNGC stehen.
- Anteil von Anleihen, die im Rahmen eines zukünftigen EU-Gesetzes, das einen EU Green Bond Standard festlegt, nicht als grün zertifiziert sind: Dieser Standard ist noch nicht finalisiert.
- Durchschnittliche Bewertung der politischen Stabilität: Die politische Stabilität wird bei allen staatlichen und regierungsnahen Emittenten anhand der Sovereign Materiality Maps bewertet und bei allen potenziellen sowie aktuellen Positionen berücksichtigt.



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: 02.01.2023 – 29.12.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
US TREASURY N/B 4,125 % 31.10.27	Staatsanleihen	3,86	Vereinigte Staaten
JAPAN GOVT 5-YR 0,100 % 20.12.25	Staatsanleihen	3,63	Japan
FNA 2017-M14 A2 TR 25.11.27	Hypothekarisch besicherte Wertpapiere (Mortgage-Backed Securities, MBS)	2,83	Vereinigte Staaten
FR SD8183 2,500 % 01.12.51	ABS – sonstige	2,23	Unbekanntes Land

JAPAN GOVT 30-YR 0,300 % 20.12.25	Staatsanleihen	2,17	Japan
US TREASURY N/B 1,875 % 31.10.27	Staatsanleihen	2,13	Vereinigte Staaten
CHINA DEV BANK 3,300 % 06.03.33	Spezialisierte Banken	2,08	China
FN FS1373 3,000 % 01.11.51	ABS – sonstige	2,06	Unbekanntes Land
REP SOUTH AFRICA 7,000 % 28.02.31	Staatsanleihen	1,90	Südafrika
US TREASURY N/B 3,500 % 31.10.27	Staatsanleihen	1,86	Vereinigte Staaten
DEUTSCHLAND REP 1,000 % 15.08.24	Staatsanleihen	1,68	Deutschland
UKTSY GILT 4,750 % 07.12.30	Staatsanleihen	1,55	Vereinigtes Königreich
INDONESIA GOV'T 7,000 % 15.02.33	Staatsanleihen	1,43	Indonesien
TSY INFL IX N/B 0,625 % 15.07.32	Staatsanleihen	1,31	Vereinigte Staaten
CHINA DEV BANK 3,020 % 06.03.33	Spezialisierte Banken	1,30	China

Die Prozentsätze stellen den Durchschnitt der 4 Quartalsenden des Bezugszeitraums dar.

Das angezeigte Land ist das Land des Risikos.

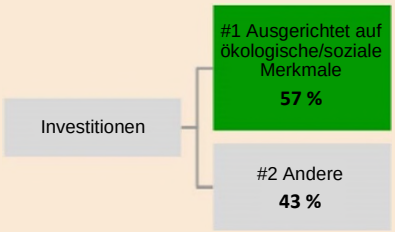
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Nicht zutreffend.

Die **Vermögens-allokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Während des Berichtszeitraums erreichte der Portfolioverwalter sein Ziel, die ökologischen Merkmale der Reduzierung der Auswirkungen des Klimawandels (das „ökologisches Merkmal“) zu bewerben.
Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 16 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die das ökologische Merkmal bewerben, von 10 % auf 50 % erhöht.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 57 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die das ökologische Merkmal bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Aufgrund der oben erwähnten überarbeiteten Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen das ökologische Merkmal bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).



#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 Sonstige ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Wichtig: Die angezeigten Ergebnisse basieren auf dem Zeitraum vom 30.06.23 bis 29.12.23. Die Verwaltungsgesellschaft ist der Ansicht, dass es angemessen ist, die Ergebnisse so darzustellen, da es ansonsten verwirrend wäre, einen Jahresdurchschnitt anzugeben. Wie oben erwähnt, haben sich die Mindestziele im Bezugszeitraum geändert. Daher ist die Verwaltungsgesellschaft nicht der Ansicht, dass es hilfreich wäre, diesen Jahresdurchschnitt mit früheren und neuen Zielen zu vergleichen, die vom Portfolioverwalter festgelegt wurden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Um das ökologische Merkmal des Portfolios zu erreichen, investierte der Portfolioverwalter z. B. in grüne Anleihen, in Unternehmen mit einem hohen Verbrauch an erneuerbaren Energien und in führende Unternehmen im Klimaschutz des Bankensektors, der Kommunikationsbranche und im supranationalen Bereich.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energien oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungs-vorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschafts-tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemis-sionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitions-ausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, auch nicht zu EU-taxonomiekonformen Investitionen. Die EU-Taxonomiekonformität der Anlagen im Fonds beträgt dementsprechend 0,0 %. Der Portfolioverwalter bewertete die Verfügbarkeit der Daten, die für die Berechnung und Offenlegung der EU-Taxonomiekonformität der Anlagen des Fonds nachträglich für den Berichtszeitraum erforderlich wären; er ist nicht der Ansicht, dass zu diesem Zeitpunkt genügend Daten für eine sinnvolle Berechnung und/oder Offenlegung verfügbar sind. Der Portfolioverwalter wird die Verfügbarkeit von Daten prüfen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

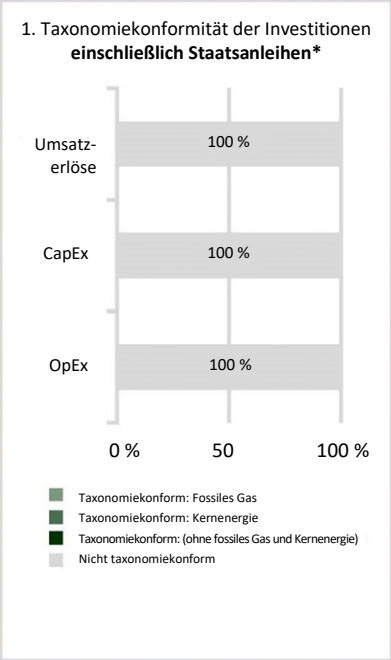
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

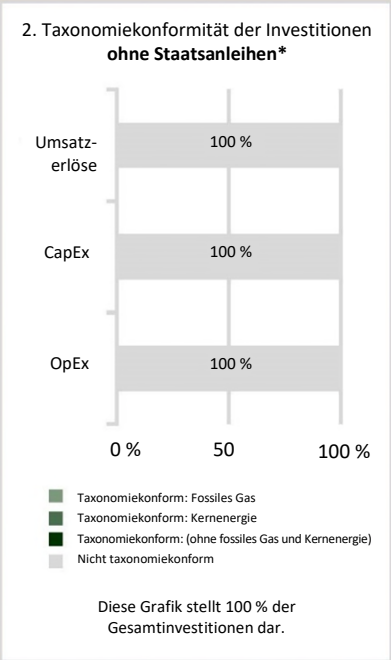
☒ Nein

1. Tätigkeiten im 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 am linken 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

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. 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 war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?***

  Nicht zutreffend.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschafts-tätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.

Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die 84 % bzw. 43 % des NIW des Fonds (zum 02.01.23 bis 30.06.23 und 30.06.23 bis 29.12.23), die die ökologischen/sozialen Merkmale nicht bewarben, wurden in einer Kombination aus einem oder mehreren der folgenden Vermögenswerte gehalten: (i) Wertpapiere, die nicht auf das ökologische Merkmal ausgerichtet waren, da sie die Nachhaltigkeitsindikatoren nicht erfüllten; (ii) Derivate, die zu Zwecken der Absicherung und des Liquiditätsmanagements abgeschlossen wurden; (iii) andere Liquiditätsmanagementtools, z. B. Geldmarktinstrumente, Bargeld und bargeldähnliche Instrumente. In Bezug auf die Wertpapiere von Unternehmen, die nicht auf das ökologische Merkmal ausgerichtet waren, unterlagen diese Investitionen dem ökologischen und sozialen Mindestschutz im Investitionsprozess, den der Portfolioverwalter für den Fonds anwendet. Unter anderem wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen solcher Investitionen vom Portfolioverwalter berücksichtigt.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Während des Bezugszeitraums entwickelte der Portfolioverwalter einen Rahmen, um Portfolios aufzubauen, die die ökologischen/sozialen Faktoren verstärken, indem er ein negatives Screening, ein internes Scoring, Überlegungen in Bezug auf den CO_2-Ausstoß und Anlagen in gelabelten Anleihen nutzt. Der Portfolioverwalter forderte sein zentrales Credit-Research-Team auch dazu auf, sich bei Emittenten zu engagieren, die schlechte interne Scores aufweisen, in Sektoren mit hohen Emissionen tätig sind oder in wesentliche Kontroversen verwickelt sind. Ein anhaltender Fokus für den Fonds ist die gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (WACI). Während des gesamten Jahres reduzierte der Portfolioverwalter die WACI des Fonds von 127,3 tCO2e zum 31.12.2022 auf 113,4 tCO2e zum 31.12.2023. Der Portfolioverwalter überwacht weiterhin ESG-gelabelte Anleihen, die den ICMA-Standards entsprechen. Der Fonds kaufte eine dänische grüne Anleihe mit einer Laufzeit von 10 Jahren im Jahr 2023 und verwendete zur Finanzierung dieses Kaufs nicht-grüne Anleihen.

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 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 die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Loomis Sayles Euro High Yield Fund
Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493007BQNX63FIM0F77

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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 Unternehmens-führung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ **Ja**

- ☐ **Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___%
  - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:** ___%

●○ ☒ **Nein**

- ☐ **Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0 % 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**.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom 02.01.23 bis 30.06.23 verwaltete der Anlageverwalter den Fonds in Übereinstimmung mit seinem Ziel zur Bewerbung der ökologischen Merkmale wie Klimaschutz, Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme (die „vorherigen Merkmale“). Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet. Die vom Fonds zu bewerbenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden auf die Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels und die Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) geändert, indem ein Teil des Fondsvermögens in Investitionen investiert wird, die als nachhaltige Investitionen gelten (die „aktuellen

Merkmale“). Vom 17.07.23 bis 29.12.23 verwaltete der Portfolioverwalter den Fonds gemäß seinem Ziel, die aktuellen Merkmale zu bewerben.
Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 31,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in ökologische/soziale Merkmale von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er die Erreichung des ökologischen Merkmals der Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels (ökologisches Merkmal) durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds, der in Emittenten investiert ist, die sich Ziele für die Verringerung der Kohlendioxidemissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % der Energie aus erneuerbaren Quellen beziehen. Darüber hinaus bewirbt der Fonds die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale“) der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Aufgrund der oben erwähnten überprüften Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie oben erwähnt, legte der Portfolioverwalter vom 02.01.23 bis zum 30.06.23 31,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Von den 31,5 % bewarben 31,3 % des Fonds den Klimawandelindikator, 0,7 % den Kreislaufwirtschaftsindikator und 1,7 % den Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme.
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren , anhand derer er das Erreichen des ökologischen Merkmals durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds in Emittenten, die sich Ziele für die Verringerung der CO_2-Emissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % des Stroms aus erneuerbaren Quellen beziehen, und 3) der Fonds ist bestrebt, die ökologischen und sozialen Merkmale der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) zu bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen gelten.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 92,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Von den 93 % waren 18 % des Fonds in Emittenten investiert, die mindestens 50 % Strom aus erneuerbaren Quellen beziehen. 32 % des Fonds wurden in nachhaltigen Investitionen gehalten.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Vom 02.01.23 bis 29.12.23 sanken die Investitionen des Fonds, die die vorherigen Merkmale bewarben, von 34 % auf 31,5 % (basierend auf einem Durchschnitt über 2 Quartale). Vom 02.01.23 bis 30.6.23 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) sank der Indikator für den Klimaschutz von 33 % auf 31 %. Der Indikator für den Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft blieb unverändert bei 1 %. Der Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme blieb ebenfalls bei 2 %. Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte der Portfolioverwalter die

Nachhaltigkeitsindikatoren des Fonds wie oben erwähnt, und der Fonds wird das ökologische und soziale Merkmal der Ausrichtung auf die SDG bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltig gelten.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds vom 17.07.23 ist das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen die der SDG-Ausrichtung. Die Investitionen tragen zu diesem Ziel bei, indem die Erlöse für grüne, soziale und nachhaltige Projekte verwendet werden, die die Kriterien der ICMA Green Bond Principles („GBP"), der Social Bond Principles („SBP") und der Sustainability Bond Guidelines („SBG") erfüllen. Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in Emittenten, deren Geschäftstätigkeit in Einklang mit den SDG steht oder die SDG fördert, besteht in einem Beitrag zu mindestens einem der folgenden Ziele für nachhaltige Entwicklung:

- SDG 2 „Kein Hunger"
- SDG 7 „Bezahlbare und saubere Energie"
- SDG 9 „Industrie, Innovation und Infrastruktur"
- SDG 11 „Nachhaltige Städte und Gemeinden"
- SDG 12 „Nachhaltige/r Konsum und Produktion" •SDG 13 „Maßnahmen zum Klimaschutz"
- SDG 13 „Maßnahmen zum Klimaschutz"

Diese nachhaltigen Investitionen tragen zu den SDG bei, indem sie mindestens 15 % ihres erzielten Umsatzes aus der Förderung eines oder mehrerer SDG generieren oder ihre Geschäftstätigkeit nach Einschätzung des Portfolioverwalters in wesentlichem Umfang auf eines oder mehrere der SDG ausrichten. Vom 30.06.2023 bis zum 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) legte der Portfolioverwalter 32 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Portfolioverwalter führte bei allen potenziellen Investitionen eine gründliche Due-Diligence-Prüfung durch, um zu beurteilen, ob eine Investition: (a) eines oder mehrere der vorstehend genannten Kriterien für nachhaltige Investitionen erfüllt; (b) andere ökologische und/oder soziale Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt und (c) die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung befolgt. Im Rahmen der Bottom-up-Analyse für potenzielle Investitionen prüfte der Portfolioverwalter, ob eine Anlage den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" erfüllt. Dies beinhaltete eine Bewertung jeder potenziellen Investition anhand der 14 obligatorischen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Anhang I Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission (die „TRS") aufgeführt sind, sowie anhand der relevanten Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der TRS. Der Portfolioverwalter prüfte auch, ob die Tätigkeit von Emittenten mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang steht. Zum 31.12.2023 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die 14 zentralen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen sowie weitere relevante optionale Indikatoren in Anhang I der TRS wurden vom Portfolioverwalter im Rahmen der Bottom-up-Analyse jeder potenziellen Investition berücksichtigt und beinhalteten daher die Prüfung von Emittenten im Hinblick auf die Faktoren Treibhausgasemissionen, Biodiversität, Wasser, Abfall sowie Soziales und Beschäftigung. Erfüllte ein Emittent die vom Portfolioverwalter festgelegten Mindestanforderungen nicht, so bestand er den Test im Hinblick auf die

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.

„Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ nicht und wurde daher nicht als nachhaltige Investition eingestuft. Ein Emittent, der den Test im Hinblick auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ nicht bestand, konnte dennoch als Investition gelten, die die derzeitigen Merkmale bewarb.

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:

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds am 17.07.23 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Darüber hinaus hielt der Fonds keine Emittenten, die von MSCI als in jüngster Zeit in eine schwerwiegende Kontroverse verwickelt eingestuft wurden, die gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) verstößt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

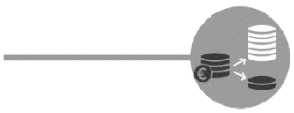
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Berichtszeitraums berücksichtigte der Portfolioverwalter die folgenden wichtigen Indikatoren für nachteilige Auswirkungen bei der Verwaltung des Fonds. Im Folgenden wird besonders darauf hingewiesen, wie die einzelnen Indikatoren behandelt wurden:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1): Dieser PAI betrug 526 tCO2e zum 31.12.23. Er lag zum 31.12.23 unter seinem repräsentativen Index.
- Engagement in Unternehmen des Bereichs fossile Brennstoffe: Das Engagement in Erdöl und Erdgas sank von 5,10 % im Jahr 2022 auf 4,35 % im Jahr 2023.
- Anteil des Verbrauchs und der Produktion nicht erneuerbarer Energien: Der Portfolioverwalter schließt die Stromerzeugung aus und den Abbau von Kraftwerkskohle aus (bis zu maximal 5 % des von diesem Emittenten erzeugten Stroms), was wir bei der Auswahl der Emittenten im Sektor Versorgungsunternehmen berücksichtigen.
- Verstöße gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen: Der Fonds war nicht in Unternehmen engagiert, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen verstoßen haben. Der Portfolioverwalter schließt Emittenten aus, die ein „Fail“ erhalten haben sind oder auf der Watchlist des Globalen Pakts der Vereinten Nationen stehen.
- Fehlen von Verfahren und Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Prinzipien des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen: Der Portfolioverwalter berücksichtigt bei der Auswahl der Emittenten unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.

- Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen): Der Fonds hatte kein Engagement in umstrittenen Waffen. Dieser Sektor ist vollständig ausgeschlossen.
- Investitionen in Unternehmen ohne Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen. Der Fonds investierte in weniger Unternehmen als im Vorjahr, die keine Initiativen zur Verringerung der Kohlenstoffemissionen mit dem Ziel der Anpassung an das Pariser Abkommen im Jahr 2023 ergriffen haben.
- Fehlen einer Richtlinie zu Menschenrechten. . Bei der Emittentenauswahl berücksichtigen wir unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.



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: 02.01.2023 – 29.12. 2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
TELEFONICA EUROP TR	Integrierte Kommunikationsdienste	2,41	Niederlande
CELLNEX TELECOM 1,875 % 26.06.29	Bauwesen – Schwerindustrie	1,91	Spanien
EDP SA TR 20.07.80*	Integrierte Elektronik	1,83	Portugal
DT LUFTHANSA AG 2,875 % 16.05.27	Fluggesellschaften	1,77	Deutschland
VODAFONE GROUP TR 27.08.80	Mobilfunkkommuni-kation	1,5	Vereinigtes Königreich
WINTERSHALL FIN TR	Ölsektor – Exploration und Produktion	1,15	Niederlande
IQVIA INC 2,250 % 15.01.28	Medizin. Lab. und Untersuchungsdienstl.	1,10	Vereinigte Staaten
ELEC DE FRANCE TR	Stromerzeugung	1,10	Frankreich
FORVIA SE 2,750 % 15.02.27	Kfz-/Lkw-Teile und -O-Ausrüst.	0,99	Frankreich
RENAULT 2,000 % 28.09.26	Pkw/Leichte Lkw	0,91	Frankreich
ILIAD 2,375 % 17.06.26	Web-Portale/ISP	0,85	Frankreich
ABERTIS FINANCE TR	Bauwesen – Schwerindustrie	0,84	Niederlande
FORD MOTOR CRED 3,250 % 15.09.25	Pkw/Leichte Lkw	0,81	Vereinigte Staaten
PPF ARENA 1 B 2,125 % 31.01.25	Mobilfunkkommuni-kation	0,80	Niederlande
ORGANON & CO/ORG 2,875 % 30.04.28	Medizin – Arzneimittel	0,80	Vereinigte Staaten

Die Prozentsätze stellen den Durchschnitt der 4 Quartalsenden des Bezugszeitraums dar. Das angezeigte Land ist das Land des Risikos.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensal-lokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

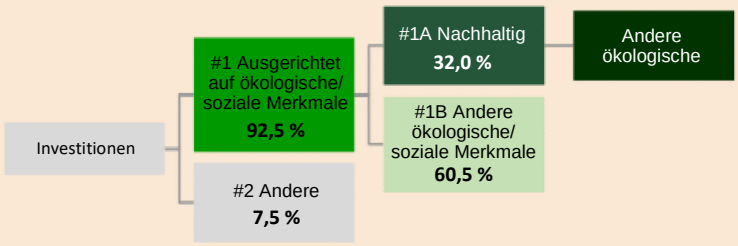
Mit der Überarbeitung von Anhang II des Fonds am 17.07.23 strebt der Fonds nun einen Anteil von 5 % in nachhaltigen Investitionen an. Daher legte der Portfolioverwalter vom 30.06.2023 bis 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) 32 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Während des Berichtszeitraums erreichte der Portfolioverwalter sein Ziel, die ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben. Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 31,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).

Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 %

auf 80 % erhöht. Darüber hinaus bewirbt der Fonds die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale“) der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte (mindestens 5 %) in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 92,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Darüber hinaus legte der Portfolioverwalter 32 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.
Aufgrund der oben erwähnten überprüften Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).



#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 Sonstige ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Wichtig: Die angezeigten Ergebnisse basieren auf dem Zeitraum vom 30.06.23 bis 29.12.23. Die Verwaltungsgesellschaft ist der Ansicht, dass es angemessen ist, die Ergebnisse so darzustellen, da es ansonsten verwirrend wäre, einen Jahresdurchschnitt anzugeben. Wie oben erwähnt, haben sich die Mindestziele im Bezugszeitraum geändert. Daher ist die Verwaltungsgesellschaft nicht der Ansicht, dass es hilfreich wäre, diesen Jahresdurchschnitt mit früheren und neuen Zielen zu vergleichen, die vom Portfolioverwalter festgelegt wurden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in den folgenden Sektoren:

- Telekommunikation,
- Kfz und Teile,
- Banken,
- Gesundheitswesen,
- Industriegüter und Dienstleistungen
- Versicherung.

Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, auch nicht zu EU-taxonomiekonformen Investitionen. Die EU-Taxonomiekonformität der Anlagen im Fonds beträgt dementsprechend 0,0 %. Der Portfolioverwalter bewertete die Verfügbarkeit der Daten, die für die Berechnung und Offenlegung der EU-Taxonomiekonformität der Anlagen des Fonds nachträglich für den Berichtszeitraum erforderlich wären; er ist nicht der Ansicht, dass zu diesem Zeitpunkt genügend Daten für eine sinnvolle Berechnung und/oder Offenlegung verfügbar sind. Der Portfolioverwalter wird die Verfügbarkeit von Daten prüfen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

1. Tätigkeiten im 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 am linken 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 Energien oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

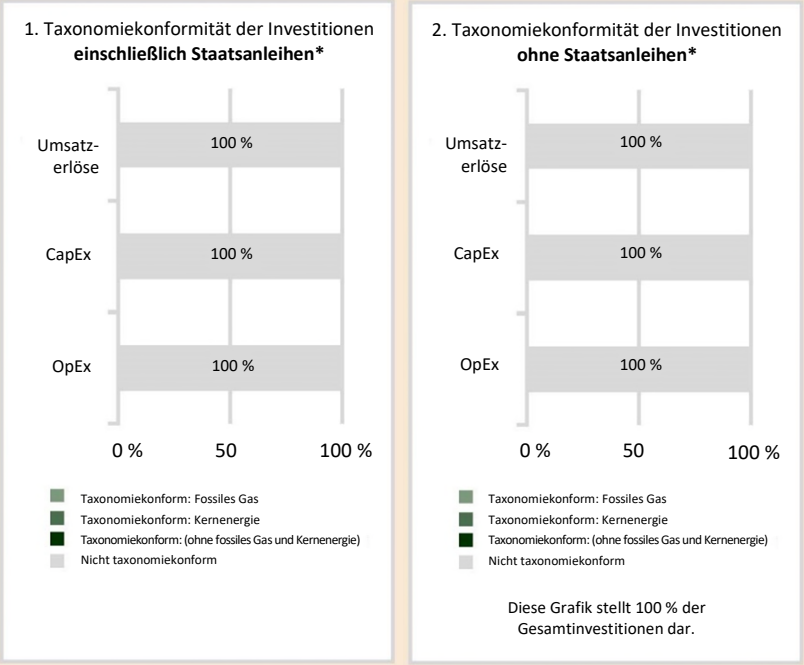
Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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 grüner Farbe. 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 war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschafts-tätigkeiten 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?

Zu jedem Zeitpunkt wird der Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der aus ökologisch nachhaltigen Investitionen gemäß der Definition der SFDR besteht, 5 % betragen. Bestimmte Investitionen können mit dem in der EU-Taxonomie festgelegten Umweltzielen konform sein. Jedoch ist der Portfolioverwalter derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Anlagen des Fonds anzugeben, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen können.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die 60,5 % bzw. 7,5 % des NIW des Fonds (zum 02.01.23 bis 30.06.23 und 30.06.23 bis 29.12.23), die die vorherigen bzw. aktuellen Merkmale nicht bewarben, wurden in einer Kombination aus einem oder mehreren der folgenden Vermögenswerte gehalten: (i) Wertpapiere, die nicht den beworbenen Merkmalen entsprachen, da sie die Nachhaltigkeitsindikatoren nicht erfüllten; (ii) Derivate, die zu Zwecken der Absicherung und des Liquiditätsmanagements abgeschlossen wurden; (iii) andere Liquiditätsmanagementtools, wie z. B. Geldmarktinstrumente, Bargeld und bargeldähnliche Instrumente. In Bezug auf die Wertpapiere von Unternehmen, die nicht auf die beworbenen Merkmalen ausgerichtet waren, unterlagen diese Investitionen dem ökologischen und sozialen Mindestschutz im Investitionsprozess, den der Portfolioverwalter für den Fonds anwendet. Unter anderem wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen solcher Investitionen vom Portfolioverwalter berücksichtigt.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Portfolioverwalter prüft das Anlageuniversum auf die Beteiligung an Aktivitäten und die Unternehmensführung. Der Portfolioverwalter stuft folgende Investitionen als nachhaltig ein: grüne, soziale und nachhaltige Anleihen, die gemäß den relevanten Grundsätzen der International Capital Markets Association („ICMA“) ausgegeben werden, sowie Anleihen von Emittenten, deren Umsatzgenerierung und/oder Geschäftstätigkeit auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) ausgerichtet sind.
Wenn der Portfolioverwalter Kenntnis von einer Kontroverse in Bezug auf einen Emittenten erhält, wird er sich engagieren, um diesen Emittenten auf ESG-Defizite aufmerksam zu machen und die Verbesserung seines fundamentalen Profils zu unterstützen. Im Bezugszeitraum engagierten wir uns bei mehreren Emittenten. Beispielsweise verkaufte der Portfolioverwalter einen Emittenten nach der Herabstufung des MSCI ESG-Ratings auf „BB“ und die Anlageteams trafen sich mit diesem Emittenten, um die Herabstufung zu besprechen. Die Herabstufung beruht auf begrenzten Belegen für die Zertifizierung als grüne Gebäude und anderen Bemühungen im Hinblick auf nachhaltige Immobilienanlagen. Auch in den Bereichen Unternehmensführung und Entwicklung des Humankapitals wurde eine schwache Bewertung erzielt. Nach dem Engagement-Meeting sah das Anlageteam keinen Grund, vom BB-Rating von MSCI ESG abzuweichen.

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 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 die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Loomis Sayles Euro Credit Fund
Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300PYGG8XYQ5ESF74

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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 Unternehmens-führung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

●● ☐ **Ja**

- ☐ **Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___%
  - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
  - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:** ___%

●○ ☒ **Nein**

- ☐ **Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben,** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 40,5 % 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**.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom 02.01.23 bis 30.06.23 verwaltete der Anlageverwalter den Fonds in Übereinstimmung mit seinem Ziel zur Bewerbung der ökologischen Merkmale wie Klimaschutz, Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme (die „vorherigen Merkmale“). Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet. Die vom Fonds zu bewerbenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden auf die Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels und die Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) geändert, indem ein Teil des Fondsvermögens in Investitionen investiert wird, die als nachhaltige Investitionen gelten (die „aktuellen

Merkmale“). Vom 17.07.23 bis 29.12.23 verwaltete der Portfolioverwalter den Fonds gemäß seinem Ziel, die aktuellen Merkmale zu bewerben.
Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 49,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in ökologische/soziale Merkmale von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er die Erreichung des ökologischen Merkmals der Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels (ökologisches Merkmal) durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds, der in Emittenten investiert ist, die sich Ziele für die Verringerung der Kohlendioxidemissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % der Energie aus erneuerbaren Quellen beziehen. Darüber hinaus bewirbt der Fonds die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale“) der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Aufgrund der oben erwähnten überprüften Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie oben erwähnt, legte der Portfolioverwalter vom 02.01.23 bis zum 30.06.23 49,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Von den 49,5 % bewarben 45 % des Fonds den Klimawandelindikator, 4 % den Indikator für den Übergang zur Kreislaufwirtschaft und 5 % den Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme.
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er das Erreichen des ökologischen Merkmals durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds in Emittenten, die sich Ziele für die Verringerung der CO2-Emissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % des Stroms aus erneuerbaren Quellen beziehen, und 3) der Fonds ist bestrebt, die ökologischen und sozialen Merkmale der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) zu bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen gelten.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). 93 % des Fonds erfüllten die Ziele zur Reduzierung des Kohlenstoffs. 31 % des Fonds wurden in Emittenten investiert, die mindestens 50 % Strom aus erneuerbaren Quellen beziehen. 40,5 % des Fonds wurden in nachhaltigen Investitionen gehalten.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Vom 02.01.23 bis 29.12.23 stiegen die Investitionen des Fonds, die die vorherigen Merkmale bewarben, von 49 % auf 49,5 % (basierend auf einem Durchschnitt über 2 Quartale). Vom 02.01.23 bis 30.06.23 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) sank der Indikator für den Klimaschutz von 46 % auf 45 %. Der Indikator für den Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft stieg von 3 % auf 4 %. Der Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme blieb unverändert bei 5 %. Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte der

Portfolioverwalter die Nachhaltigkeitsindikatoren des Fonds wie oben erwähnt, und der Fonds wird das ökologische und soziale Merkmal der Ausrichtung auf die SDG bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltig gelten.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds vom 17.07.23 ist das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen die der SDG-Ausrichtung. Die Investitionen tragen zu diesem Ziel bei, indem die Erlöse für grüne, soziale und nachhaltige Projekte verwendet werden, die die Kriterien der ICMA Green Bond Principles („GBP"), der Social Bond Principles („SBP") und der Sustainability Bond Guidelines („SBG") erfüllen.
Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in Emittenten, deren Geschäftstätigkeit in Einklang mit den SDG steht oder die SDG fördert, besteht in einem Beitrag zu mindestens einem der folgenden Ziele für nachhaltige Entwicklung:

- SDG 2 „Kein Hunger"
- SDG 7 „Bezahlbare und saubere Energie"
- SDG 9 „Industrie, Innovation und Infrastruktur"
- SDG 11 „Nachhaltige Städte und Gemeinden"
- SDG 12 „Nachhaltige/r Konsum und Produktion"
- SDG 13 „Maßnahmen zum Klimaschutz"

Diese nachhaltigen Investitionen tragen zu den SDG bei, indem sie mindestens 15 % ihres erzielten Umsatzes aus der Förderung eines oder mehrerer SDG generieren, oder indem sie nach Einschätzung des Portfolioverwalters ihre Geschäftstätigkeit in wesentlichem Umfang auf eines oder mehrere der SDG ausrichten. Vom 30.06.2023 bis 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) legte der Portfolioverwalter 40,5 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Portfolioverwalter führte bei allen potenziellen Investitionen eine gründliche Due-Diligence-Prüfung durch, um zu beurteilen, ob eine Investition: (a) eines oder mehrere der vorstehend genannten Kriterien für nachhaltige Investitionen erfüllt; (b) andere ökologische und/oder soziale Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt und (c) die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung befolgt. Im Rahmen der Bottom-up-Analyse für potenzielle Investitionen prüfte der Portfolioverwalter, ob eine Anlage den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" erfüllt. Dies beinhaltete eine Bewertung jeder potenziellen Investition anhand der 14 obligatorischen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Anhang I Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission (die „TRS") aufgeführt sind, sowie anhand der relevanten Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der TRS. Der Portfolioverwalter prüfte auch, ob die Tätigkeit von Emittenten mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang steht. Zum 31.12.2023 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

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?

Die 14 zentralen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen sowie weitere relevante optionale Indikatoren in Anhang I der TRS wurden vom Portfolioverwalter im Rahmen der Bottom-up-Analyse jeder potenziellen Investition berücksichtigt und beinhalteten daher die Prüfung von Emittenten im Hinblick auf die Faktoren Treibhausgasemissionen, Biodiversität, Wasser, Abfall sowie Soziales und Beschäftigung. Erfüllte ein Emittent die vom Portfolioverwalter festgelegten Mindestanforderungen nicht, so bestand er den Test im Hinblick auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" nicht und wurde daher nicht als

nachhaltige Investition eingestuft. Ein Emittent, der den Test im Hinblick auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ nicht bestand, konnte dennoch als Investition gelten, die die aktuellen Merkmale bewirbt.

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:

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds vom 17.07.23 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Darüber hinaus hielt der Fonds keine Emittenten, die von MSCI als in jüngster Zeit in eine schwerwiegende Kontroverse verwickelt eingestuft wurden, die gegen eines oder mehrere der zehn Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) verstößt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

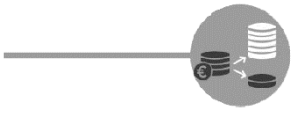
Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Berichtszeitraums berücksichtigte der Portfolioverwalter die folgenden wichtigen Indikatoren für nachteilige Auswirkungen bei der Verwaltung des Fonds. Im Folgenden wird besonders darauf hingewiesen, wie die einzelnen Indikatoren behandelt wurden:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1): Dieser PAI betrug 5298 tCO2e zum 31.12.23. Er lag zum 31.12.23 unter seinem repräsentativen Index.
- Engagement in Unternehmen des Bereichs fossile Brennstoffe: Das Engagement in Erdöl und Erdgas sank von 4,20 % im Jahr 2022 auf 3,90 % im Jahr 2023.
- Anteil des Verbrauchs und der Produktion nicht erneuerbarer Energien: Das Anlageteam schließt die Stromerzeugung aus und den Abbau von Kraftwerkskohle aus (bis zu maximal 5 % des von diesem Emittenten erzeugten Stroms), was wir bei der Auswahl der Emittenten im Sektor Versorgungsunternehmen berücksichtigen.
- Verstöße gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen: Der Fonds war nicht in Unternehmen engagiert, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen verstoßen haben. Das Anlageteam schließt Emittenten aus, die ein „Fail“ erhalten haben sind oder auf der Watchlist des Globalen Pakts der Vereinten Nationen stehen.
- Fehlen von Verfahren und Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale

Unternehmen: Das Anlageteam berücksichtigt bei der Auswahl der Emittenten unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.

- Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen): Der Fonds hatte kein Engagement in umstrittenen Waffen. Dieser Sektor ist im Fonds vollständig ausgeschlossen.
- Investitionen in Unternehmen ohne Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen: Der Fonds investierte in weniger Unternehmen als im Vorjahr, die keine Initiativen zur Verringerung der Kohlenstoffemissionen mit dem Ziel der Anpassung an das Pariser Abkommen im Jahr 2023 ergriffen haben.
- Fehlen einer Richtlinie zu Menschenrechten. Bei der Emittentenauswahl berücksichtigte der Portfolioverwalter unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.



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: 02.01.2023 – 29.12.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DEUTSCHLAND REP 4,000 % 04.01.37	Staatsanleihen	1,23	Deutschland
NAT GRD ELCT EM 3,530 % 20.09.28	Elektroverteilung	0,87	Vereinigtes Königreich
AT&T INC 1,600 % 19.05.28	Integrierte Kommunikationsdienste	0,71	Vereinigte Staaten
VERIZON COMM INC 4,250 % 31.10.30	Integrierte Kommunikationsdienste	0,62	Vereinigte Staaten
BNP PARIBAS TR 13.04.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,60	Frankreich
SOCIETE GENERALE TR 02.12.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,59	Frankreich
BG ENERGY CAP 2,250 % 21.11.29	Ölsektor – Exploration und Produktion	0,57	Vereinigtes Königreich
DEUTSCHLAND REP 1,000 % 15.08.24	Staatsanleihen	0,56	Deutschland
TOTALENERGIES SE TR	Ölgesellschaften – Integriert	0,56	Frankreich
CRED AGRICOLE SA TR 22.04.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,53	Frankreich
PROLOGIS EURO 1,000 % 08.02.29	REIT – Lager/Industrie	0,52	Vereinigte Staaten
UBS GROUP TR 03.11.26	Diversifiziertes Bankinstitut	0,51	Schweiz
VISA INC 1,500 % 15.06.26	Finanzen – Kreditkarten	0,51	Vereinigte Staaten
BOOKING HLDS INC 4,250 % 15.05.29	E-Commerce/Dienste	0,50	Vereinigte Staaten
ELEC DE FRANCE 4,375 % 12.10.29	Stromerzeugung	0,48	Frankreich

Die Prozentsätze stellen den Durchschnitt der 4 Quartalsenden des Bezugszeitraums dar.
Das angezeigte Land ist das Land des Risikos.

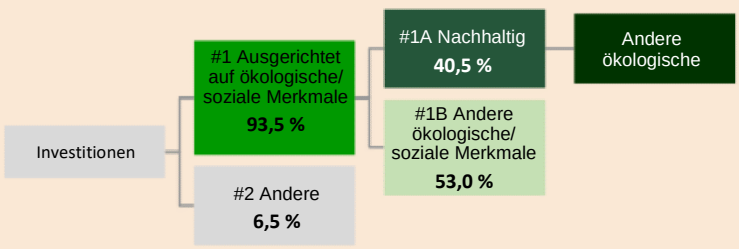
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Mit der Überarbeitung von Anhang II des Fonds am 17.07.23 strebt der Fonds nun einen Anteil von 5 % in nachhaltigen Investitionen an. Daher legte der Portfolioverwalter vom 30.06.2023 bis 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) 40,5 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Während des Berichtszeitraums erreichte der Portfolioverwalter sein Ziel, die ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben. Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 49,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus bewirbt der Portfolioverwalter die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale") der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG"), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte (mindestens 5 %) in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Darüber hinaus legte der Portfolioverwalter 40,5 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.
Aufgrund der oben erwähnten überprüften Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).



#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 Sonstige ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Wichtig: Die angezeigten Ergebnisse basieren auf dem Zeitraum vom 30.06.23 bis 29.12.23. Die Verwaltungsgesellschaft ist der Ansicht, dass es angemessen ist, die Ergebnisse so darzustellen, da es ansonsten verwirrend wäre, einen Jahresdurchschnitt anzugeben. Wie oben erwähnt, haben sich die Mindestziele im Bezugszeitraum geändert. Daher ist die Verwaltungsgesellschaft nicht der Ansicht, dass es hilfreich wäre, diesen Jahresdurchschnitt mit früheren und neuen Zielen zu vergleichen, die vom Portfolioverwalter festgelegt wurden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in den folgenden Sektoren:

- Banken,
- Versorgungsunternehmen,
- Immobilien,
- Gesundheitswesen,
- Telekommunikation
- Versicherung.

Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen, auch nicht zu EU-taxonomiekonformen Investitionen. Die EU-Taxonomiekonformität der Anlagen im Fonds beträgt dementsprechend 0,0 %. Der Portfolioverwalter bewertete die Verfügbarkeit der Daten, die für die Berechnung und Offenlegung der EU-Taxonomiekonformität der Anlagen des Fonds nachträglich für den Berichtszeitraum erforderlich wären; er ist nicht der Ansicht, dass zu diesem Zeitpunkt genügend Daten für eine sinnvolle Berechnung und/oder Offenlegung verfügbar sind. Der Portfolioverwalter wird die Verfügbarkeit von Daten prüfen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

☒ Nein

1. Tätigkeiten im 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 am linken 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 Energien oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungs-vorschriften.

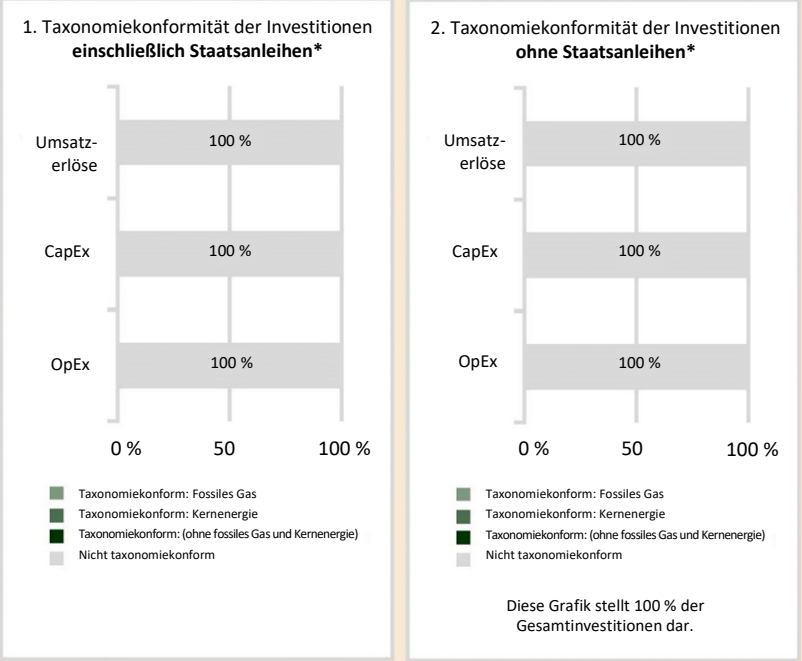
Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Wirtschafts-tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitions-ausgaben** (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 grüner Farbe. 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 war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschafts-tätigkeiten 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?

Zu jedem Zeitpunkt wird der Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der aus ökologisch nachhaltigen Investitionen gemäß der Definition der SFDR besteht, 5 % betragen. Bestimmte Investitionen können mit dem in der EU-Taxonomie festgelegten Umweltzielen konform sein. Jedoch ist der Portfolioverwalter derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Anlagen des Fonds anzugeben, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen können.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die 50,5 % bzw. 6,5 % des NIW des Fonds (zum 02.01.23 bis 30.06.23 und 30.06.23 bis 29.12.23), die die vorherigen bzw. aktuellen Merkmale nicht bewarben, wurden in einer Kombination aus einem oder mehreren der folgenden Vermögenswerte gehalten: (i) Wertpapiere, die nicht den beworbenen Merkmalen entsprachen, da sie die Nachhaltigkeitsindikatoren nicht erfüllten; (ii) Derivate, die zu Zwecken der Absicherung und des Liquiditätsmanagements abgeschlossen wurden; (iii) andere Liquiditätsmanagementtools, wie z. B. Geldmarktinstrumente, Bargeld und bargeldähnliche Instrumente. In Bezug auf die Wertpapiere von Unternehmen, die nicht auf die beworbenen Merkmalen ausgerichtet waren, unterlagen diese Investitionen dem ökologischen und sozialen Mindestschutz im Investitionsprozess, den der Portfolioverwalter für den Fonds anwendet. Unter anderem wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen solcher Investitionen vom Portfolioverwalter berücksichtigt.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Portfolioverwalter prüft das Anlageuniversum auf die Beteiligung an Aktivitäten und die Unternehmensführung. Der Portfolioverwalter stuft folgende Investitionen als nachhaltig ein: grüne, soziale und nachhaltige Anleihen, die gemäß den relevanten Grundsätzen der International Capital Markets Association („ICMA") ausgegeben werden, sowie Anleihen von Emittenten, deren Umsatzgenerierung und/oder Geschäftstätigkeit auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG") ausgerichtet sind.
Wenn der Portfolioverwalter Kenntnis von einer Kontroverse in Bezug auf einen Emittenten erhält, wird er sich engagieren, um diesen Emittenten auf ESG-Defizite aufmerksam zu machen und die Verbesserung seines fundamentalen Profils zu unterstützen. Im Bezugszeitraum engagierten wir uns bei mehreren Emittenten. Beispielsweise verkaufte das Anlageteam einen Emittenten nach der Herabstufung des MSCI ESG-Ratings auf „BB" und der Portfolioverwalter traf sich mit diesem Emittenten, um die Herabstufung zu besprechen. Die Herabstufung beruht auf begrenzten Belegen für die Zertifizierung als grüne Gebäude und anderen Bemühungen im Hinblick auf nachhaltige Immobilienanlagen. Auch in den Bereichen Unternehmensführung und Entwicklung des Humankapitals wurde eine schwache Bewertung erzielt. Nach dem Engagement-Meeting sah der Portfolioverwalter keinen Grund, vom BB-Rating von MSCI ESG abzuweichen.

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 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 die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

Vorlage – Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: Loomis Sayles Sustainable Euro Credit Fund
Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493004JQ6F5CHHHN741

Ökologische und/oder soziale Merkmale

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 Unternehmens-führung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ Ja	☒ Nein
☐ **Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___%	☐ **Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben,** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 52,0 % an nachhaltigen Investitionen.
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:** ___%	☐ mit einem sozialen Ziel
	☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Mit **Nachhaltigkeits-indikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Vom 02.01.23 bis 30.06.23 verwaltete der Anlageverwalter den Fonds in Übereinstimmung mit seinem Ziel zur Bewerbung der ökologischen Merkmale wie Klimaschutz, Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme (die „vorherigen Merkmale“). Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet. Die vom Fonds zu bewerbenden ökologischen und sozialen Merkmale wurden auf die Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels und die Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) geändert, indem ein Teil des Fondsvermögens in Investitionen investiert wird, die als nachhaltige Investitionen gelten (die „aktuellen Merkmale“). Vom 17.07.23 bis 29.12.23 verwaltete der Portfolioverwalter den Fonds gemäß seinem Ziel, die aktuellen Merkmale zu bewerben.

Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 49,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in ökologische/soziale Merkmale von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte und identifizierte der Portfolioverwalter die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren, anhand derer er die Erreichung des ökologischen Merkmals der Verringerung der Auswirkungen des Klimawandels (ökologisches Merkmal) durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds, der in Emittenten investiert ist, die sich Ziele für die Verringerung der Kohlendioxidemissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % der Energie aus erneuerbaren Quellen beziehen. Darüber hinaus bewirbt der Fonds die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale") der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG"), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Aufgrund der oben erwähnten überprüften Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Wie oben erwähnt, legte der Portfolioverwalter vom 02.01.23 bis zum 30.06.23 49,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Von den 49,5 % bewarben 45 % des Fonds den Indikator für den Klimaschutz, 4 % den Indikator für den Übergang zur Kreislaufwirtschaft und 5 % den Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme.
Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Der Portfolioverwalter hat außerdem die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren überarbeitet und festgelegt, anhand derer er das Erreichen des ökologischen Merkmals durch den Fonds messen wird: 1) Prozentsatz des Fonds in Emittenten, die sich Ziele für die Verringerung der CO2-Emissionen gesetzt haben, auf die aktiv hingearbeitet wird, und 2) Investitionen in Emittenten, die mindestens 50 % des Stroms aus erneuerbaren Quellen beziehen, und 3) der Fonds ist bestrebt, die ökologischen und sozialen Merkmale der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG") zu bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen gelten.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 93,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). 93 % des Fonds erfüllten die Ziele zur Reduzierung des Kohlenstoffs. 31 % des Fonds wurden in Emittenten investiert, die mindestens 50 % Strom aus erneuerbaren Quellen beziehen. 40,5 % des Fonds wurden in nachhaltigen Investitionen gehalten.

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Vom 02.01.23 bis 29.12.23 stiegen die Investitionen des Fonds, die die vorherigen Merkmale bewarben, von 49 % auf 49,5 % (basierend auf einem Durchschnitt über 2 Quartale). Vom 02.01.23 bis 30.6.23 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) sank der Indikator für den Klimaschutz von 46 % auf 45 %, der Indikator für den Übergang zu einer Kreislaufwirtschaft stieg von 3 % auf 4 % und der Indikator für den Schutz und die Wiederherstellung der biologischen Vielfalt und der Ökosysteme blieb unverändert bei 5 %. Wie oben erwähnt, wurde Anhang II des Fonds am 17.07.23 überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus überprüfte der Portfolioverwalter die Nachhaltigkeitsindikatoren des Fonds wie oben erwähnt, und der Fonds wird das

ökologische und soziale Merkmal der Ausrichtung auf die SDG bewerben, indem er einen Teil seines Vermögens in Investitionen anlegt, die als nachhaltig gelten.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds vom 17.07.23 ist das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen die der SDG-Ausrichtung. Die Investitionen tragen zu diesem Ziel bei, indem die Erlöse für grüne, soziale und nachhaltige Projekte verwendet werden, die die Kriterien der ICMA Green Bond Principles („GBP"), der Social Bond Principles („SBP") und der Sustainability Bond Guidelines („SBG") erfüllen.
Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds in Emittenten, deren Geschäftstätigkeit in Einklang mit den SDG steht oder die SDG fördert, besteht in einem Beitrag zu mindestens einem der folgenden Ziele für nachhaltige Entwicklung:

- SDG 2 „Kein Hunger"
- SDG 7 „Bezahlbare und saubere Energie"
- SDG 9 „Industrie, Innovation und Infrastruktur"
- SDG 11 „Nachhaltige Städte und Gemeinden"
- SDG 12 „Nachhaltige/r Konsum und Produktion"
- SDG 13 „Maßnahmen zum Klimaschutz"

Diese nachhaltigen Investitionen tragen zu den SDG bei, indem sie mindestens 15 % ihres erzielten Umsatzes aus der Förderung eines oder mehrerer SDG generieren, oder indem sie nach Einschätzung des Portfolioverwalters ihre Geschäftstätigkeit in wesentlichem Umfang auf eines oder mehrere der SDG ausrichten. Vom 30.06.2023 bis 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) legte der Portfolioverwalter 52 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Der Portfolioverwalter führte bei allen potenziellen Investitionen eine gründliche Due-Diligence-Prüfung durch, um zu beurteilen, ob eine Investition: (a) eines oder mehrere der vorstehend genannten Kriterien für nachhaltige Investitionen erfüllt; (b) andere ökologische und/oder soziale Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigt und (c) die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung befolgt. Im Rahmen der Bottom-up-Analyse für potenzielle Investitionen prüfte der Portfolioverwalter, ob eine Anlage den Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" erfüllt. Dies beinhaltete eine Bewertung jeder potenziellen Investition anhand der 14 obligatorischen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen, die in Anhang I Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 der Kommission (die „TRS") aufgeführt sind, sowie anhand der relevanten Indikatoren aus den Tabellen 2 und 3 in Anhang I der TRS. Der Portfolioverwalter prüfte auch, ob die Tätigkeit von Emittenten mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang steht.
Zum 31.12.2023 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die 14 zentralen Nachhaltigkeitsindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen sowie weitere relevante optionale Indikatoren in Anhang I der TRS wurden vom Portfolioverwalter im Rahmen der Bottom-up-Analyse jeder potenziellen Investition berücksichtigt und beinhalteten daher die Prüfung von Emittenten im Hinblick auf die Faktoren Treibhausgasemissionen, Biodiversität, Wasser, Abfall sowie Soziales und Beschäftigung. Erfüllte ein Emittent die vom Portfolioverwalter festgelegten Mindestanforderungen nicht, so bestand er den Test im Hinblick auf die „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen" nicht und wurde daher nicht als nachhaltige Investition eingestuft. Ein Emittent, der den Test im Hinblick auf die

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.

„Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ nicht bestand, konnte dennoch als Investition gelten, die die aktuellen Merkmale bewirbt.

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:

Gemäß der Überarbeitung von Anhang II des Fonds am 17.07.23 standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang. Darüber hinaus hielt der Fonds keine Emittenten, die von MSCI als in jüngster Zeit in eine schwerwiegende Kontroverse verwickelt eingestuft wurden, die gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) verstößt.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

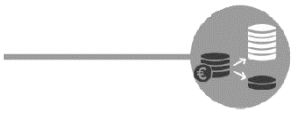
Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Während des Berichtszeitraums berücksichtigte der Portfolioverwalter die folgenden wichtigen Indikatoren für nachteilige Auswirkungen bei der Verwaltung des Fonds. Im Folgenden wird besonders darauf hingewiesen, wie die einzelnen Indikatoren behandelt wurden:

- Treibhausgasemissionen (Scope 1): Dieser PAI betrug 14.225 tCO2e zum 31.12.23. Er lag zum 31.12.23 unter seinem repräsentativen Index.
- Engagement in Unternehmen des Bereichs fossile Brennstoffe: Dieser Sektor ist vollständig ausgeschlossen.
- Anteil des Verbrauchs und der Produktion nicht erneuerbarer Energien: Der Portfolioverwalter schließt die Stromerzeugung aus und den Abbau von Kraftwerkskohle aus (bis zu maximal 20 % des von diesem Emittenten erzeugten Stroms), was wir bei der Auswahl der Emittenten im Versorgungssektor berücksichtigen.
- Verstöße gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen: Der Fonds war nicht in Unternehmen engagiert, die gegen die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen verstoßen haben. Der Portfolioverwalter schließt Emittenten aus, die ein „Fail“ erhalten haben sind oder auf der Watchlist des Globalen Pakts der Vereinten Nationen stehen.
- Fehlen von Verfahren und Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen: Der Portfolioverwalter berücksichtigt bei der Auswahl der Emittenten unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.
- Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische Waffen und biologische Waffen): Der Fonds hatte kein Engagement in umstrittenen Waffen. Dieser Sektor ist vollständig ausgeschlossen.
- Investitionen in Unternehmen ohne Ziele zur Reduzierung der Kohlenstoffemissionen: Der Fonds investierte in weniger Unternehmen als im Vorjahr, die keine Initiativen zur

Verringerung der Kohlenstoffemissionen mit dem Ziel der Anpassung an das Pariser Abkommen im Jahr 2023 ergriffen haben.
- Fehlen einer Richtlinie zu Menschenrechten. Bei der Emittentenauswahl berücksichtigte der Portfolioverwalter unter anderem die Vereinigungsfreiheit und das Recht auf Kollektivverhandlungen.



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: 02.01.2023 – 29.12.2023

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DEUTSCHLAND REP 4,000 % 04.01.37	Staatsanleihen	1,39	Deutschland
NAT GRD ELCT EM 3,530 % 20.09.28	Elektroverteilung	0,81	Vereinigtes Königreich
AT&T INC 1,600 % 19.05.28	Integrierte Kommunikationsdienste	0,75	Vereinigte Staaten
SOCIETE GENERALE TR 02.12.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,64	Frankreich
BOOKING HLDS INC 4,250 % 15.05.29	E-Commerce/Dienste	0,63	Vereinigte Staaten
PROLOGIS EURO 1,000 % 08.02.29	REIT – Lager/Industrie	0,59	Vereinigte Staaten
ARGENTUM NETH 1,125 % 17.09.25	Chemikalien – Spezial	0,58	Niederlande
MEDTRONIC GLOBAL 1,125 % 07.03.27	Medizinische Instrumente	0,58	Luxemburg
CRED AGRICOLE SA TR 22.04.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,57	Frankreich
BNP PARIBAS TR 13.04.27	Diversifiziertes Bankinstitut	0,57	Frankreich
VISA INC 1,500 % 15.06.26	Finanzen – Kreditkarten	0,57	Vereinigte Staaten
VERIZON COMM INC 4,250 % 31.10.30	Integrierte Kommunikationsdienste	0,56	Vereinigte Staaten
DEUTSCH BAHN FIN 1,375 % 03.03.34	Transport – Schienenverkehr	0,55	Deutschland
COMPASS GROUP 3,000 % 08.03.30	Gastronomie – Catering	0,55	Niederlande
UBS GROUP TR 03.11.26	Diversifiziertes Bankinstitut	0,53	Schweiz

Die Prozentsätze stellen den Durchschnitt der 4 Quartalsenden des Bezugszeitraums dar. Das angezeigte Land ist das Land des Risikos.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

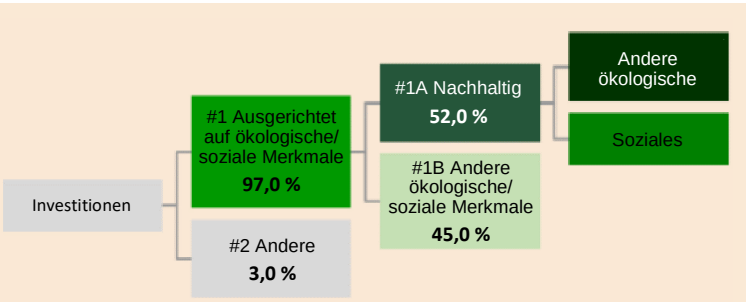
Mit der Überarbeitung von Anhang II des Fonds am 17.07.23 strebt der Fonds nun einen Anteil von 50 % in nachhaltigen Investitionen an. Daher legte der Portfolioverwalter vom 30.06.2023 bis 31.12.2023 (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen) 52 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig eingestuft wurden.

Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Während des Berichtszeitraums erreichte der Portfolioverwalter sein Ziel, die ökologischen und sozialen Merkmale zu bewerben. Vom 02.01.23 bis 30.06.23 legte der Portfolioverwalter 51 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die vorherigen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen).
Am 17.07.23 wurde Anhang II des Fonds überarbeitet und die angestrebte Mindestallokation in Investitionen, die die aktuellen Merkmale bewerben, von 10 % auf 80 % erhöht. Darüber hinaus bewirbt der Fonds nun die ökologischen und sozialen Merkmale (zusammen die „Merkmale“) der Ausrichtung auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“), indem er einen Teil seiner Vermögenswerte

(mindestens 50 %) in Investitionen anlegt, die als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.
Vom 30.06.23 bis 29.12.23 legte der Portfolioverwalter 97 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Investitionen an, die die aktuellen Merkmale bewerben (basierend auf einem Durchschnitt von 2 Quartalen). Darüber hinaus legte der Portfolioverwalter 52 % des Fondsvermögens in Investitionen an, die als nachhaltig angesehen wurden.
Aufgrund der oben erwähnten überarbeiteten Merkmale und Nachhaltigkeitsindikatoren änderte sich die Methodik zur Berechnung, welche Investitionen die beworbenen Merkmale bewerben, im Berichtszeitraum vom 02.01.23 bis 29.12.23. Bitte beachten Sie daher die beiden oben genannten Ergebnisse (die einen für den Zeitraum vom 02.01.23 bis 30.06.23 und die anderen für den 30.06.23 bis 29.12.23).



#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 Sonstige ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Ergebnisse so darzustellen, da es ansonsten verwirrend wäre, einen Jahresdurchschnitt anzugeben. Wie oben erwähnt, haben sich die Mindestziele im Bezugszeitraum geändert. Daher ist die Verwaltungsgesellschaft nicht der Ansicht, dass es hilfreich wäre, diesen Jahresdurchschnitt mit früheren und neuen Zielen zu vergleichen, die vom Portfolioverwalter festgelegt wurden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Die Investitionen erfolgten in den folgenden Sektoren:

- Banken,
- Versorgungsunternehmen,
- Gesundheitswesen,
- Immobilien,
- Telekommunikation
- Versicherung.

Mit Blick auf die EU-Taxonomie-konformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energien oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungs-vorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangs-tätigkeiten sind Wirtschafts-tätigkeiten, für die es noch keine CO_2-armen Alternativen gibt und die Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitions-ausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Der Fonds verpflichtet sich nicht zu taxonomiekonformen Investitionen. Die EU-Taxonomiekonformität der Anlagen im Fonds beträgt dementsprechend 0,0 %. Der Portfolioverwalter bewertete die Verfügbarkeit der Daten, die für die Berechnung und Offenlegung der EU-Taxonomiekonformität der Anlagen des Fonds nachträglich für den Berichtszeitraum erforderlich wären; er ist nicht der Ansicht, dass zu diesem Zeitpunkt genügend Daten für eine sinnvolle Berechnung und/oder Offenlegung verfügbar sind. Der Portfolioverwalter wird die Verfügbarkeit von Daten prüfen.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert[1]?

☐ Ja:

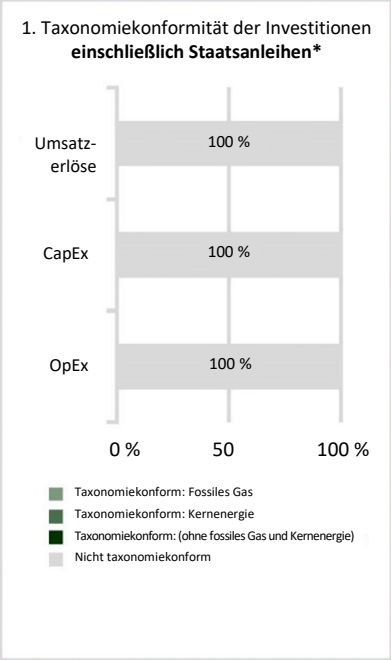
☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie

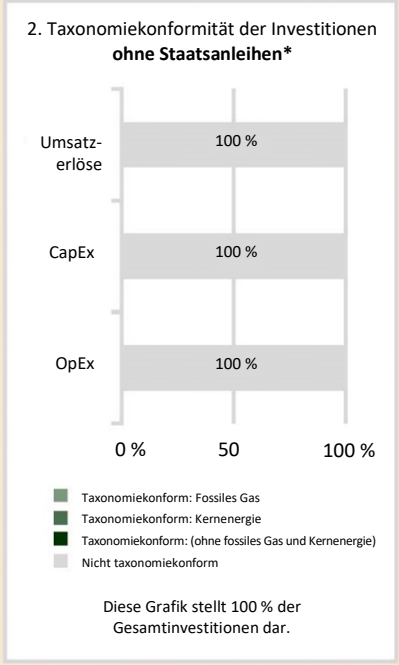
☒ Nein

1. Tätigkeiten im 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 am linken 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

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. 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 war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Nicht zutreffend.

Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

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?

Zu jedem Zeitpunkt wird der Mindestanteil des Nettoinventarwerts des Fonds, der aus ökologisch nachhaltigen Investitionen gemäß der Definition der SFDR besteht, 5 % betragen. Bestimmte Investitionen können mit dem in der EU-Taxonomie festgelegten Umweltzielen konform sein. Jedoch ist der Portfolioverwalter derzeit nicht in der Lage, den genauen Anteil der zugrunde liegenden Anlagen des Fonds anzugeben, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen können.

Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.

Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Die 49 % bzw. 3 % des NIW des Fonds (zum 02.01.23 bis 30.06.23 und 30.06.23 bis 29.12.23), die die vorherigen bzw. aktuellen Merkmale nicht bewarben, wurden in einer Kombination aus einem oder mehreren der folgenden Vermögenswerte gehalten: (i) Wertpapiere, die nicht den beworbenen Merkmalen entsprachen, da sie die Nachhaltigkeitsindikatoren nicht erfüllten; (ii) Derivate, die zu Zwecken der Absicherung und des Liquiditätsmanagements abgeschlossen wurden; (iii) andere Liquiditätsmanagementtools, wie z. B. Geldmarktinstrumente, Bargeld und bargeldähnliche Instrumente. In Bezug auf die Wertpapiere von Unternehmen, die nicht auf die beworbenen Merkmalen ausgerichtet waren, unterlagen diese Investitionen dem ökologischen und sozialen Mindestschutz im Investitionsprozess, den der Portfolioverwalter für den Fonds anwendet. Unter anderem wurden die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen solcher Investitionen vom Portfolioverwalter berücksichtigt.

Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Der Portfolioverwalter prüft das Anlageuniversum auf die Beteiligung an Aktivitäten und die Unternehmensführung. Der Portfolioverwalter stuft folgende Investitionen als nachhaltig ein: grüne, soziale und nachhaltige Anleihen, die gemäß den relevanten Grundsätzen der International Capital Markets Association („ICMA“) ausgegeben werden, sowie Anleihen von Emittenten, deren Umsatzgenerierung und/oder Geschäftstätigkeit auf die Ziele für nachhaltige Entwicklung („SDG“) ausgerichtet sind.
Wenn der Portfolioverwalter Kenntnis von einer Kontroverse in Bezug auf einen Emittenten erhält, wird er sich engagieren, um diesen Emittenten auf ESG-Defizite aufmerksam zu machen und die Verbesserung seines fundamentalen Profils zu unterstützen. Im Bezugszeitraum engagierten wir uns bei mehreren Emittenten. Beispielsweise verkaufte das Anlageteam einen Emittenten nach der Herabstufung des MSCI ESG-Ratings auf „BB“ und das Anlageteam traf sich mit diesem Emittenten, um die Herabstufung zu besprechen. Die Herabstufung beruht auf begrenzten Belegen für die Zertifizierung als grüne Gebäude und anderen Bemühungen im Hinblick auf nachhaltige Immobilienanlagen. Auch in den Bereichen Unternehmensführung und Entwicklung des Humankapitals wurde eine schwache Bewertung erzielt. Nach dem Engagement-Meeting sah der Portfolioverwalter keinen Grund, vom BB-Rating von MSCI ESG abzuweichen.

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 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 die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.

- ***Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?***

  Nicht zutreffend.