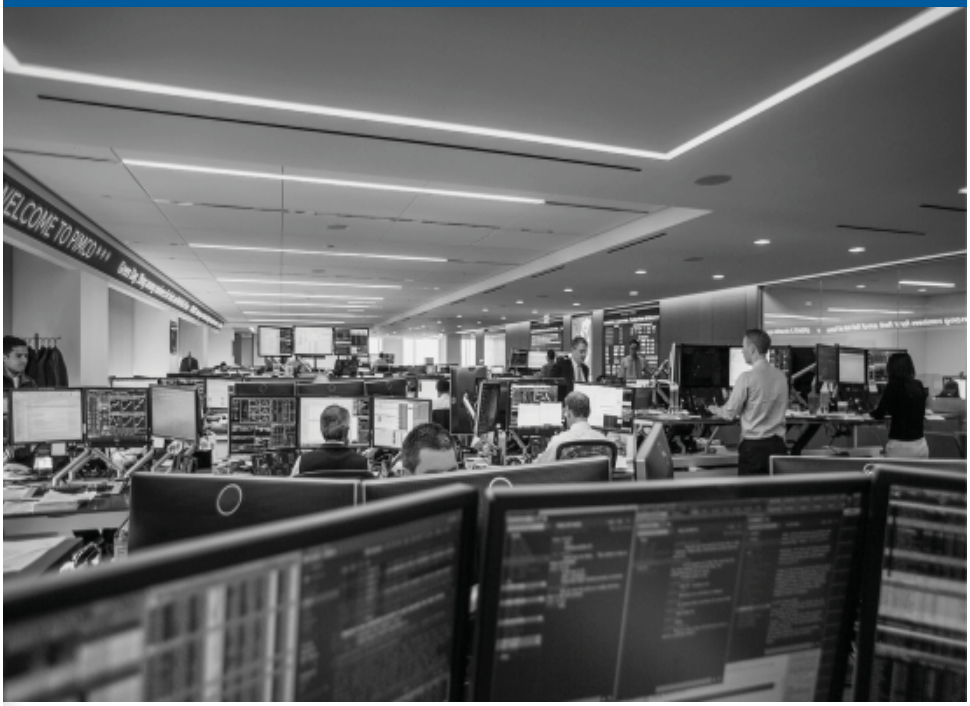
PIMCO

# Jahresbericht

*31. Dezember 2015*




**PIMCO Funds: Global Investors Series plc**

Eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und gesonderter Haftung der einzelnen Teilfonds, die mit beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 eingetragen wurde und von der Central Bank of Ireland als Organismus für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren), in der jeweils geltenden Fassung, und nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren, OGAW) von 2011 genehmigt wurde.

A company of Allianz

# PIMCO Funds: Global Investors Series plc Jahresbericht zum 31. Dezember 2015

## ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**
UCITS

**Anzahl an Teilfonds der Gesellschaft:**
56 Teilfonds

**Anteilsklassen der Gesellschaft:***
Institutional Class
Institutional AUD (Hedged) Class
Institutional CAD (Hedged) Class
Institutional CHF (Hedged) Class
Institutional CHF (Partially Hedged) Class
Institutional CHF (Unhedged) Class
Institutional CZK (Hedged) Class
Institutional DKK (Partially Hedged) Class
Institutional EUR (Currency Exposure) Class
Institutional EUR (Hedged) Class
Institutional EUR (Partially Hedged) Class
Institutional EUR (Unhedged) Class
Institutional GBP (Hedged) Class
Institutional GBP (Partially Hedged) Class
Institutional GBP (Unhedged) Class
Institutional HKD (Unhedged) Class
Institutional HUF (Hedged) Class
Institutional ILS (Hedged) Class
Institutional JPY (Hedged) Class
Institutional NOK (Hedged) Class
Institutional NOK (Partially Hedged) Class
Institutional NZD (Hedged) Class
Institutional PLN (Hedged) Class
Institutional SEK (Hedged) Class
Institutional SGD (Hedged) Class
Institutional USD (Currency Exposure) Class
Institutional USD (Unhedged) Class
Investor Class
Investor CHF (Hedged) Class
Investor CHF (Unhedged) Class
Investor EUR (Hedged) Class
Investor EUR (Partially Hedged) Class
Investor EUR (Unhedged) Class
Investor GBP (Hedged) Class
Investor GBP (Partially Hedged) Class
Investor NOK (Hedged) Class
Investor SEK (Hedged) Class
Investor USD (Currency Exposure) Class
Administrative Class
Administrative CHF (Hedged) Class
Administrative EUR (Hedged) Class
Administrative EUR (Unhedged) Class
Administrative GBP (Hedged) Class
Administrative SEK (Hedged) Class
Administrative SGD (Hedged) Class
Class E
Class E CHF (Hedged)
Class E EUR (Hedged)
Class E EUR (Partially Hedged)
Class E EUR (Unhedged)
Class E GBP (Hedged)
Class E HKD (Unhedged)
Class E RMB (Hedged)
Class E SGD (Hedged)
Class E USD (Currency Exposure)
Class E USD (Unhedged)
Class G Institutional
Class G Institutional EUR (Hedged)
Class G Institutional EUR (Partially Hedged)
Class G Institutional EUR (Unhedged)
Class G Retail EUR (Currency Exposure)
Class G Retail EUR (Hedged)
Class G Retail EUR (Unhedged)
Klasse H Institutional
Class M Retail
Class M Retail AUD (Hedged)
Class M Retail HKD (Unhedged)
Class M Retail SGD (Hedged)
Class R
Class R EUR (Hedged)
Class R GBP (Hedged)
Class R GBP (Partially Hedged)
Class R GBP (Unhedged)
Class R USD (Currency Exposure)
Class S
Class S CHF (Hedged)
Class S EUR (Hedged)
Class S GBP (Hedged)
Class T
Class T EUR (Hedged)
Class T EUR (Partially Hedged)
Class T EUR (Unhedged)
Class T USD (Unhedged)
Class Z
Class Z AUD (Hedged)
Class Z USD (Currency Exposure)

* Nicht jeder Fonds bietet alle aufgeführten Anteilsklassen an.

**Anteilsarten:**
Innerhalb jeder Klasse darf die Gesellschaft, vorbehaltlich der jeweiligen Ergänzung, ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und Income II-Anteile (eine erhöhte Rendite ausschüttende Anteile) ausgeben. Innerhalb der Investor Classes darf der Income Fund auch ausschüttende A-Anteile (Anteile, die auf jährlicher Basis einen Ertrag ausschütten) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**
€79.753.646 (USD 86.636.385).

**Mindestbestand:**
Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Investor, Administrative sowie Class G Institutional und Class H Institutional liegt bei 500.000 USD oder dem gleichen Betrag in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse Der Mindestbestand für die Anteilsklassen Institutional sowie Class S liegt insgesamt bei 500.000 USD oder dem gleichen Betrag in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse, wobei der Mindestbetrag je Teilfonds bei 100.000 USD oder dem gleichen Betrag in der jeweiligen Währung der Anteilsklasse liegt. Der Mindestbestand für Anteile der Class E, Class G Retail, Class R und Class T liegt bei Anlage über das Sammelkonto eines Intermediärs bei 5.000 USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilsklassenwährung bzw. bei Direktanlage über NSCC FundServe bei 25.000 USD. Der Mindestbestand für Anteile der Class M Retail liegt bei 5.000 USD dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilsklassenwährung. Der Mindestbestand für die Anteile der Class Z liegt bei 20 Mio. USD oder dem Gegenwert in der jeweiligen Anteilsklassenwährung. Die Pacific Investment Management Company LLC ist nach eigenem Ermessen befugt, auf das Erfordernis der Mindestanfangszeichnung, Mindestfolgezeichnung und des Mindestbestandes gemäß dem aktuellen Verkaufsprospekt zu verzichten.

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

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

**Funktionswährung der Teilfonds:**
USD ($), ausgenommen der Teilfonds UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund, UK Low Duration Fund, UK Real Return Fund and UK Sterling Long Average Duration Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, und der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Low Duration Fund, Euro Real Return Fund, Euro Short-Term Fund, Euro Ultra-Long Duration Fund und PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, die auf Euro (€) lauten.

**Zulassung in Hongkong:**
Die folgenden Teilfonds sind in Hongkong nicht zugelassen und für Einwohner von Hongkong nicht erhältlich:

PIMCO Capital Securities Fund
PIMCO Credit Absolute Return Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund
Emerging Markets 2018 Fund
Emerging Markets Corporate Bond Fund
Euro Credit Fund
Euro Income Bond Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Low Duration Fund
Euro Real Return Fund
Euro Short-Term Fund
Euro Ultra-Long Duration Fund
Global Advantage Fund
Global Advantage Real Return Fund
Global Bond Ex-US Fund
Global Low Duration Real Return Fund
Global Multi-Asset Fund
Inflation Strategy Fund
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund
PIMCO RAE Fundamental US Fund
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund
StocksPLUS™ Fund
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund
UK Low Duration Fund
UK Real Return Fund
UK Sterling Long Average Duration Fund
Unconstrained Bond Fund
US Short-Term Fund
US Small Cap StocksPLUS™ Fund

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

PIMCO Capital Securities Fund
PIMCO Credit Absolute Return Fund
Emerging Markets 2018 Fund
Euro Credit Fund
Euro Income Bond Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Low Duration Fund
Euro Real Return Fund
Euro Short-Term Fund
Euro Ultra-Long Duration Fund
Global Low Duration Real Return Fund
Inflation Strategy Fund
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Fundamental Europe Fund
PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund
PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund
PIMCO RAE Fundamental US Fund
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund
UK Low Duration Fund
UK Real Return Fund
UK Sterling Long Average Duration Fund
US Short-Term Fund
US Small Cap StocksPLUS™ Fund

**Reuters-Seite:**
PAFPPLC

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

*Diese Version unseres Berichts ist eine Übersetzung des Originals, das auf Englisch erstellt wurde. Wir haben alle angemessene Sorgfalt walten lassen, um sicherzustellen, dass die Übersetzung das Original genau wiedergibt. In sämtlichen Belangen, die eine Interpretation von Informationen, Ansichten oder Meinungen betreffen, hat die englische Originalfassung unseres Berichts jedoch Vorrang vor dieser Übersetzung.*

# Inhalt


| | Seite |
|---|---|
| Schreiben des Vorsitzenden | 4 |
| Wichtige Angaben zu den Teilfonds | 5 |
| Beschreibungen der Vergleichsindizes | 68 |
| Finanzstatus | 74 |
| Betriebsergebnisrechnung | 96 |
| Ausweis der Nettovermögensänderungen | 118 |
| Anlagen- und Vermögenswertportfolio & Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung | 126 |
| Erläuterungen zum Abschluss | 671 |
| Bericht des Verwaltungsrats | 802 |
| Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers | 805 |
| Bericht der Depotbank | 806 |
| Referenzinformationen | 807 |
| Begriffsbestimmungen | 811 |
| Allgemeine Informationen | 812 |

| TEILFONDS | Teilfonds-überblick | Anlagen- und Vermögens-wertportfolio |
|---|---|---|
| PIMCO Capital Securities Fund | 6 | 126 |
| Commodity Real Return Fund | 7 | 135 |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | 8 | 145 |
| Diversified Income Fund | 9 | 156 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 11 | 172 |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | 12 | 183 |
| Emerging Asia Bond Fund | 13 | 190 |
| Emerging Local Bond Fund | 14 | 197 |
| Emerging Markets 2018 Fund | 15 | 209 |
| Emerging Markets Bond Fund | 16 | 214 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 17 | 226 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 18 | 234 |
| Euro Bond Fund | 19 | 242 |
| Euro Credit Fund | 20 | 254 |
| Euro Income Bond Fund | 21 | 261 |
| Euro Long Average Duration Fund | 22 | 270 |
| Euro Low Duration Fund | 23 | 278 |
| Euro Real Return Fund | 24 | 284 |
| Euro Short-Term Fund | 25 | 288 |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | 26 | 294 |
| Global Advantage Fund | 27 | 301 |
| Global Advantage Real Return Fund | 28 | 317 |
| Global Bond Fund | 29 | 329 |
| Global Bond Ex-US Fund | 31 | 351 |
| PIMCO Global Dividend Fund | 32 | 364 |
| Global High Yield Bond Fund | 33 | 369 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 34 | 380 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 36 | 402 |
| Global Multi-Asset Fund | 37 | 412 |
| Global Real Return Fund | 38 | 426 |
| Income Fund | 39 | 439 |
| Inflation Strategy Fund | 41 | 458 |
| Low Average Duration Fund | 42 | 469 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 43 | 481 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 44 | 489 |
| PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund | 45 | 494 |
| PIMCO RAE Fundamental Europe Fund | 46 | 499 |
| PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund | 47 | 504 |

| TEILFONDS | Teilfonds-überblick | Anlagen- und Vermögens-wertportfolio |
|---|---|---|
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 48 | 510 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | 49 | 519 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | 50 | 531 |
| PIMCO RAE Fundamental US Fund | 51 | 541 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 52 | 546 |
| StocksPLUS™ Fund | 53 | 555 |
| Strategic Income Fund | 54 | 565 |
| Total Return Bond Fund | 55 | 575 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 57 | 591 |
| UK Corporate Bond Fund | 58 | 597 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 59 | 604 |
| UK Low Duration Fund | 60 | 612 |
| UK Real Return Fund | 61 | 618 |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | 62 | 624 |
| Unconstrained Bond Fund | 63 | 630 |
| US High Yield Bond Fund | 65 | 647 |
| US Short-Term Fund | 66 | 656 |
| US Small Cap StocksPLUS™ Fund | 67 | 664 |

# Schreiben des Vorsitzenden

**Sehr geehrte Anteilinhaber,**

wir freuen uns, Ihnen den Jahresbericht der PIMCO Funds: Global Investors Series plc vorzulegen, der den am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Zwölfmonatsberichtszeitraum umfasst. Auf den folgenden Seiten finden Sie genaue Informationen über das Anlageergebnis der einzelnen Teilfonds und eine Darstellung der Faktoren, die die Wertentwicklung beeinflusst haben.

Im Folgenden ein kurzer Überblick über das Geschehen auf den Finanzmärkten während des zwölfmonatigen Berichtszeitraums:

- Die erhöhte Marktvolatilität während des Berichtszeitraums wurde durch eine Kombination verschiedener Sorgen von Anlegern ausgelöst, unter anderem in Bezug auf geopolitische Entwicklungen, Geldpolitik und die Möglichkeit einer Abschwächung des weltweiten Wirtschaftswachstums. All dies trug dazu bei, die Stimmung unter den Anleger einzutrüben. Insbesondere die zunehmenden Sorgen um den Ausblick für das Wachstum in China zogen eine Abschwächung der Rohstoffpreise und der Inflationserwartungen nach sich. Auch die Kurse von Schuldtiteln und Aktien aus Schwellenländern wurden hierdurch in Mitleidenschaft gezogen. Darüber hinaus begann der chinesische Aktienmarkt im Juni 2015 einen starken Rückgang, der die chinesische Regierung dazu veranlasste, die Aktienkurse künstlich zu stützen und den chinesischen Yuan abzuwerten. Die Volatilität an den chinesischen Aktienmärkten setzte sich angesichts neuerlicher Sorgen um die Verlangsamung des chinesischen Wirtschaftswachstums bis Januar 2016 fort. Darüber hinaus trugen zunehmende Spannungen im Nahen Osten und die anhaltende Schuldenkrise in Griechenland während des gesamten Berichtszeitraums zur Unruhe unter den Anlegern bei.
- Die Wirtschaftsdaten aus den USA bestätigten auch weiterhin eine gesunde Konjunktur. Dies galt insbesondere für Arbeitsmarktindikatoren wie die Arbeitslosenquote und die Lohnentwicklung. Dennoch waren auch weiterhin Anzeichen auf eine vorsichtigere Stimmung zu beobachten: Insbesondere die US-amerikanischen Verbraucher schienen in ihrem Ausgabeverhalten selektiver vorzugehen und entschieden sich in weiten Teilen dafür, die unerwartete Finanzspritze durch niedrige Benzinpreise lieber zu sparen als sie auszugeben. Darüber hinaus schwächten sich die Verbraucherstimmung sowie verschiedene Indikatoren zur Immobilienbranche gegen Ende des Berichtszeitraums ab. Im Dezember 2015 deuteten die US-Fertigungsdaten auf die schnellste Abkühlung seit sechs Jahren hin. Innerhalb der Eurozone erhöhte sich die Volatilität trotz der allmählichen Verbesserung der zugrundeliegenden Wirtschaft. Auch die Wirtschaftsdaten aus der Eurozone ließen allgemein positive Anzeichen auf den Anfang einer Erholung erkennen, wurden jedoch durch die schleppende Inflation leicht gedämpft.
- Das Thema der gegenläufigen geldpolitischen Ausrichtung der verschiedenen globalen Zentralbanken setzte sich während des Berichtszeitraums fort. Die Europäische Zentralbank („EZB“) verpflichtete sich darauf, ihre quantitative Lockerung (d.h. umfangreiche Käufe von Vermögenswerten) zu verstärken. Auch die Bank of Japan und die People's Bank of China ließen ihre Absicht erkennen, entsprechende Maßnahmen verstärken zu wollen. Derweil beschloss die US-Notenbank (Federal Reserve, „Fed“) am 16. Dezember, ihren Leitzins (Federal Funds Rate) um 0,25 % auf einen neuen Bereich von 0,25 % - 0,50 % anzuheben und führte damit die erste Zinserhöhung seit neun Jahren durch. Allerdings merkte die Fed an, dass künftige Leitzinserhöhungen „allmählich“ und im Einklang mit den bisherigen Prognosen erfolgen würden, was dazu beitrug, die Sorgen der Anleger zu zerstreuen. Nach Ende des Berichtszeitraums entschied sich die Fed am 27. Januar dafür, ihren Leitzinssatz unverändert zu belassen. Sie kündigte an, die Auswirkungen der Weltwirtschaft und der Märkte auf den Konjunkturausblick für die USA genau im Auge behalten zu wollen.
- Die Zinsstrukturkurve der Kernländer der Eurozone wurde 2015 steiler: Die kurzfristigen Renditen gingen zurück (zweijährige deutsche Bundesanleihen gaben um 25 Basispunkte nach), während längerfristige Renditen gegenüber ihrem Stand zum Jahresanfang zulegten (die Rendite auf 30-jährige deutsche Bundesanleihen erhöhte sich um 10 Basispunkte). Im ersten Quartal des Berichtszeitraums gingen die Renditen aufgrund des Programms der EZB zur quantitativen Lockerung, im Zuge dessen sie Staatsanleihen kaufte, zurück. Im zweiten Quartal stiegen die Renditen angesichts der erhöhten Volatilität an den Zinsmärkten jedoch sprunghaft an. Die Spreads auf Staatsanleihen der meisten Peripherieländer der Eurozone verengten sich während des Berichtszeitraums geringfügig, während die Sorgen um Griechenland abklangen und sich die zyklische Erholung fortsetzte. Der Spread zehnjähriger italienischer Staatsanleihen gegenüber vergleichbaren deutschen Bundesanleihen verringerte sich während des Berichtszeitraums um 38 Basispunkte.
- Globale Unternehmensanleihen mit Investment Grade gaben, gemessen am Barclays Global Aggregate Credit Total Return Index (USD Unhedged), während des Berichtszeitraums um 3,55 % nach. Auf globaler Ebene erweiterten sich die Spreads auf Unternehmensanleihen, da der weltweite Unternehmenssektor von der Abschwächung in China und den Turbulenzen an den Energiemärkten in Mitleidenschaft gezogen wurde. Die globalen Hochzinsanleihen gaben, gemessen am Barclays Global High Yield Total Return Index (USD Unhedged), während des Berichtszeitraums um 2,72 % nach. Gemessen am Barclays High Yield Index nahm der durchschnittliche Spread für US-Hochzinsanleihen während des Berichtszeitraums zu. Belastet wurde die Anlageklasse vor allem durch den Energiesektor, der die Renditen auf Hochzinspapiere angesichts des sinkenden Ölpreises drückte. Die US-Unternehmensanleihen mit Investment Grade gerieten ebenfalls unter Druck, da die Kreditspreads auf globale Investment Grade-Titel während des Berichtszeitraums zulegten.
- Die am JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global gemessenen Auslandsschulden von Schwellenmärkten erzielten während des Berichtszeitraums eine Rendite von 1,23 %. Durch den JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildete lokale Anleihen aus Schwellenmärkten gingen während des Berichtszeitraums um 14,92 % zurück. Die Märkte wurden auch weiterhin vor allem durch idiosynkratische Entwicklungen bestimmt. So setzte China beispielsweise seine expansiven Maßnahmen fort, da sowohl das Wachstum als auch die Inflation Anzeichen auf eine weitere Abschwächung erkennen ließen. Darüber hinaus setzte der russische Rubel seine Erholung gegenüber der 2014 verzeichneten Schwäche fort, bevor er gegen Ende des Berichtszeitraums aufgrund der Schwäche der Ölpreise wieder nachgab.
- Globale inflationsgebundene Anleihen („ILBs“) gaben während des Berichtszeitraums nach, da der Rückgang im Energiesektor sowie bei anderen Rohstoffen die Inflationserwartungen weltweit dämpfte. Trotz dieser Belastung entwickelten sich europäische ILBs besser als die Werte anderer Industrieländer und verbuchten in Lokalwährung gemessen leichte Zugewinne, da die Realrenditen von den quantitativen Lockerungsmaßnahmen der EZB profitierten.
- Preise für breite Rohstoffkategorien gaben während des Berichtszeitraums nach, allen voran die Preise für Energie und Industriemetalle. Die Rohölpreise gerieten durch hartnäckig hohe Vorräte und eine Steigerung der Fördermengen (insbesondere durch die Organisation erdölexportierender Länder („OPEC“)) zunehmend unter Druck. Gegen Ende des Berichtszeitraums kam der Ölpreis durch das saisonal warme Wetter zusätzlich unter Druck. Bei den diversifizierten Rohstoffen war gemessen am Bloomberg Commodity Index Total Return während des Berichtszeitraums ein Rückgang um 24,66 % zu beobachten.
- Die Aktienmärkte verbuchten auf globaler Ebene eine durchwachsene Wertentwicklung, da der Berichtszeitraum vor allem durch wirtschaftliche Unsicherheit, erhöhte Volatilität und die gegenläufige Geldpolitik der Zentralbanken bestimmt wurde. US-amerikanische Aktien erzielten, gemessen am S&P 500 Index, eine Rendite von 1,38 % (auf Basis der Gesamtrendite), während die Aktien von Industrieländern außerhalb der USA, gemessen am MSCI EAFE Net Dividend Index (USD Unhedged), während des Berichtszeitraums um 0,81 % nachgaben. Die ultralockere Geldpolitik in Europa und Japan kam jedoch den europäischen und japanischen Aktienmärkten zugute, so dass diese allgemein positive Renditen verbuchten. Die am MSCI Emerging Markets Index (Net Dividends in USD) gemessenen Schwellenmarktaktien hingegen gaben während desselben Zeitraums um 14,92 % nach, was vor allem der Belastung durch den stärkeren US-Dollar, sinkende Rohstoffpreise, Sorgen um das schwächere Wirtschaftswachstum in China und Kursverluste chinesischer Aktien zuzuschreiben war.

Bei Fragen bezüglich PIMCO Funds: Global Investors Series plc, wenden Sie sich bitte an den Verwalter: **+353 (1) 603 6200.**

Wir danken Ihnen erneut für das uns entgegengebrachte Vertrauen. Wir schätzen Ihr Vertrauen und arbeiten weiter unentwegt daran, Ihren breit gefächerten Anlagebedarf zu erfüllen.

Mit freundlichem Gruß

William R. Benz
Vorsitzender
26. April 2016

## Wichtige Angaben zu den Teilfonds

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

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

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

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Überblicksseiten der einzelnen Teilfonds in diesem Bericht bieten eine Übersicht über den Gesamtertrag der Anlageentwicklung, in der die Wertentwicklung – davon ausgehend, dass alle Dividenden und Kapitalgewinnausschüttungen wiederangelegt wurden – gemessen wird. Anlageerträge und der Kapitalwert schwanken, sodass der Wert der Fonds-Anteile bei Rücknahme über oder unter ihrem ursprünglichen Wert liegen kann. In den Erträgen ist der Abzug von Steuern, die ein Anteilinhaber auf (i) Ausschüttungen des Teilfonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Teilfonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. Die aktuelle Wertentwicklung kann geringer oder höher ausfallen als die angeführten Wertentwicklungsdaten. Sämtliche Teilfondserträge verstehen sich nach Gebühren und Aufwendungen.

Anlagen in einem Teilfonds gelten nicht als Bankeinlagen und werden nicht von einer behördlichen Stelle verbürgt oder versichert. Der Wert der und die Einkünfte aus den Anteilen am Teilfonds können steigen oder sinken und eventuell erhalten Sie nicht den ursprünglich in den Teilfonds investierten Betrag zurück.

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd, 11 Baker Street, London W1U 3AH, England; PIMCO Asia Pte Ltd., 501 Orchard Road #09-03, Wheelock Place, Singapur 238880 und PIMCO Australia Pty Ltd., Level 19, 5 Martin Place, 363 George Street, Sydney, New South Wales 2000 Australien; www.pimco.com.

# PIMCO Capital Securities Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2013) | 3,89 % | 7,05 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Sept. 2014) | 3,85 % | 2,97 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2014) | 3,48 % | 2,51 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (19. Mai 2014) | 3,51 % | 2,53 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 3,30 % | 6,22 % |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 3,37 % | 6,20 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2013) | 2,96 % | 5,00 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2014) | 2,93 % | 2,03 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 2,87 % | 4,02 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. März 2014) | 3,72 % | 3,44 % |
| Class S, ausschüttende Anteile (Auflegung, 14. Feb. 2014) | 3,87 % | 4,21 % |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 2,53 % | 3,77 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2013) | 4,73 % | 6,57 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,29 % | 0,26 % [2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Aug 2015) | — | 0,20 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | — | 0,84 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 2,71 % | 6,05 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014) | 1,83 % | 0,13 % |
| Class S CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. März 2015) | — | (0,50 %) |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (1,15 %) | (0,53 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 3,63 % | 6,59 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 3,56 % | 6,58 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 29. Juli 2014) | 3,57 % | 2,34 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 2,97 % | 6,00 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2013) | 2,69 % | 4,83 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung 30. Okt. 2015) | — | (0,78 %) |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014) | 3,44 % | 1,46 % |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. März 2015) | — | 0,10 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | 2,18 % | 2,39 % |
| 3 Month Euribor | 0,01 % | 0,13 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Aug. 2013) | 4,07 % | 7,00 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2013) | 4,15 % | 7,29 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2014) | 3,85 % | 1,92 % |
| 3 Month GBP-LIBOR-Index | 0,57 % | 0,55 % [2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Feb. 2015) | — | 1,14 % |
| 3 Month STIBOR Index | — | (0,19 %) |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 30. Okt. 2015) | — | (0,33 %) |
| Class M Retail SGD (Hedged), ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 3,83 % | 4,40 % |
| 3 Month SGD LIBOR Index | 1,39 % | 0,83 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO Capital Securities Fund strebt Engagements mit Fokus auf Capital Securities (wie im Verkaufsprospekt definiert) zusammen mit einer maximalen Gesamtrendite an, in Übereinstimmung mit der Kapitalerhaltung und umsichtigen Anlageverwaltung durch die Anlage in ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten bestehendes Portfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) und andere Wertpapiere, von denen gemäß den im Verkaufsprospekt des Teilfonds angegebenen Richtlinien mindestens 80 % in Capital Securities angelegt werden.

» Ein Engagement in bedingten Capital Tier 1-Anleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums eine positive Wertentwicklung an den Tag legten.

» Ein Engagement in bedingten Capital Tier 2-Anleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums eine positive Wertentwicklung an den Tag legten.

» Ein Engagement in Bankkapital Tier 1-Anleihen alten Stils war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums eine positive Wertentwicklung an den Tag legten.

» Ein Engagement in ausgewählten bedingten Capital Tier 1-Anleihen aus Schwellenländern schmälerte die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums negative Renditen auswiesen.

# Commodity Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2006) | (25,26 %) | (5,83 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Aug. 2011) | (25,41 %) | (14,41 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Sept. 2007) | (25,91 %) | (8,09 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2006) | (26,00 %) | (6,62 %) |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (25,31 %) | (17,81 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (24,60 %) | (2,51 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return | (24,66 %) | (7,17 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Juni 2010) | (26,00 %) | (7,55 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. März 2012) | (26,74 %) | (15,48 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged) | (25,97 %) | (8,83 %)[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Das Engagement bei Rohstoffmärkten war für die Wertentwicklung nachteilig, da die Preise während des Berichtszeitraums nachgaben.

» Innerhalb des Rohstoffsektors war das Engagement im Energiebereich für die Wertentwicklung nachteilig, da die Preise während des Berichtszeitraums nachgaben.

» Innerhalb des Rohstoffsektors war das Engagement in der Landwirtschaft für die Wertentwicklung nachteilig, da die Preise während des Berichtszeitraums nachgaben.

» Innerhalb des Rohstoffsektors war das Engagement bei Industriemetallen für die Wertentwicklung nachteilig, da die Preise während des Berichtszeitraums nachgaben.

# PIMCO Credit Absolute Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2011) | (3,35 %) | 2,22 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Juni 2013) | (3,76 %) | (1,11 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (4,17 %) | (1,17 %) |
| 3 Month USD LIBOR Index | 0,29 % | 0,32 % [2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2012) | (4,42 %) | (0,86 %) |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (1,15 %) | (0,45 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2011) | (3,71 %) | 2,04 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013) | (3,67 %) | (0,50 %) |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Juni 2013) | (4,07 %) | (1,35 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (4,48 %) | (1,34 %) |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (3,72 %) | (1,94 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (4,77 %) | (4,90 %) |
| 3 Month Euribor | 0,01 % | 0,37 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2011) | (3,15 %) | 2,44 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (3,23 %) | 0,13 % |
| 3 Month GBP-LIBOR-Index | 0,57 % | 0,64 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO Credit Absolute Return Fund strebt unter Schutz des Kapitals und umsichtiger Anlageverwaltung in verschiedenen Marktumgebungen eine positive Gesamtrendite an, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten investiert. Der Teilfonds bemüht sich um einen positiven Gesamtertrag, und nicht um einen Ertrag, der einen bestimmten Vergleichsindex übertrifft. Er zielt unabhängig davon, ob die Märkte steigen oder sinken, auf die Generierung absoluter Erträge ab.

» Ein Long-Engagement bei verbrieften Papieren war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums insgesamt eine positive Wertentwicklung an den Tag legten.

» Ein Long-Engagement im Finanzsektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da der Sektor während des Berichtszeitraums positive Erträge auswies.

» Ein Long-Engagement im Energiesektor war der Performance abträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums negative Renditen auswies.

» Ein Long-Engagement bei ausgewählten Telekommunikationswerten war der Wertentwicklung abträglich, da diese während des Berichtszeitraums negative Renditen auswiesen.

» Ein Long-Engagement bei US-Duration (oder sensible Reaktion auf Änderungen der Marktzinsen) war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze während des Berichtszeitraums anstiegen.

# Diversified Income Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005) | (0,63 %) | 6,32 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2008) | (0,59 %) | 6,84 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. April 2013) | (0,90 %) | (0,41 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2013) | (1,02 %) | (0,46 %) |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2011) | (1,10 %) | 3,45 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006) | (1,52 %) | 5,41 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006) | (1,53 %) | 5,53 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Juni 2011) | (0,82 %) | 3,75 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (1,57 %) | 3,65 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (1,45 %) | 0,69 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,82 %) | 0,97 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (2,02 %) | (2,66 %) |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (1,92 %) | (2,60 %) |
| Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Feb. 2012) | 0,00 % | 4,29 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, USD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged | 0,16 % | 6,15 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class M Retail AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Dez. 2012) | 0,46 % | 2,35 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, AUD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, AUD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, AUD Hedged | 2,22 % | 4,05 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Dez. 2011) | (0,32 %) | 5,25 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, CAD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CAD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CAD Hedged | 0,40 % | 5,76 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011) | (2,04 %) | 3,20 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2012) | (1,90 %) | 1,30 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, CHF Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CHF Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CHF Hedged | (1,29 %) | 3,93 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2007) | (0,97 %) | 6,01 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Okt. 2007) | (0,91 %) | 6,20 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Juli 2007) | (1,28 %) | 6,02 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013) | (1,27 %) | 0,22 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Juli 2007) | (1,51 %) | 5,87 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Aug. 2011) | (1,53 %) | 3,46 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juli 2007) | (1,84 %) | 5,50 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung 16. Okt. 2009) | (1,88 %) | 5,01 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (0,94 %) | 0,24 % |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. März 2012) | (1,88 %) | 2,18 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (2,34 %) | (3,13 %) |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (2,21 %) | (3,08 %) |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, EUR Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged | (0,25 %) | 5,48 %[2] |

## Kommentare zum Portfolio

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

» Beteiligungen an Bankkapitalpapieren, die von einer konstanten Carry-Erzielung und Wertpapierauswahl profitierten, wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Preise für diese Beteiligungen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Verbriefte Schuldverschreibungen trugen zur Wertentwicklung bei, da dank Verbesserungen bei US-Immobilienpreisen während des Berichtszeitraums ein Carry erzielt wurde und die Wertpapierauswahl günstig ausfiel.

» Ein Engagement bei russischen Auslands-schulden waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Kurse dieser Wertpapiere während des Berichtszeitraums stiegen.

» Die taktische Short-Positionierung des Teilfonds gegenüber dem Euro lieferte einen positiven Beitrag zur relativen Wertentwicklung, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.

» Eine Übergewichtung brasilianischer Unternehmen und quasi-staatlicher Emittenten sowie lokaler brasilianischer Zinsen belastete die Wertentwicklung, da lokale brasilianische Zinssätze und Kreditrisikoprämien auf brasilianische Staatsanleihen während des Berichtszeitraums anstiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2006) | (0,54 %) | 6,76 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2006) | (0,42 %) | 6,62 % |
| Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2011) | (1,06 %) | 3,58 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,74 %) | 1,07 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, GBP Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged | 0,27 % | 6,41 %[2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (1,11 %) | 6,40 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, SEK Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged | (0,33 %) | 5,90 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Jan. 2013) | (0,84 %) | 0,07 % |
| jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, SGD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged | 1,12 % | 1,91 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# Diversified Income Duration Hedged Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2011) | (1,50 %) | 2,42 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (am 30. Okt. 2015 aufgelegt) | — | (1,48 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,85 %) | (2,55 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,92 %) | (2,55 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2013) | (2,42 %) | (1,36 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2011) | (2,34 %) | 1,59 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,70 %) | (0,02 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (2,76 %) | (3,99 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Mai 2011) | (0,90 %) | 3,10 % |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit Component USD Hdgd, BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained USD Hdgd, JPMorgan EMBI Global | (1,70 %) | 1,93 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2011) | (1,82 %) | 2,94 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013) | (1,82 %) | (0,94 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Aug. 2011) | (2,64 %) | 2,34 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Mai 2013) | (2,77 %) | (2,42 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (3,13 %) | (5,79 %) |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, EUR Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged | (2,25 %) | 2,76 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Aug. 2011) | (1,51 %) | 3,69 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2013) | (1,56 %) | (0,37 %) |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, GBP Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged | (1,50 %) | 3,30 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Sept. 2013) | (1,61 %) | (1,43 %) |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, SGD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged | (0,92 %) | 0,52 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Beteiligungen an Bankkapitalpapieren, die von einer konstanten Carry-Erzielung und Wertpapierauswahl profitierten, wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Preise für diese Beteiligungen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Verbriefte Schuldverschreibungen trugen zur Wertentwicklung bei, da dank Verbesserungen bei US-Immobilienpreisen während des Berichtszeitraums ein Carry erzielt wurde und die Wertpapierauswahl günstig ausfiel.

» Ein Engagement bei russischen Auslandsschulden waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Kurse dieser Wertpapiere während des Berichtszeitraums stiegen.

» Die taktische Short-Positionierung des Teilfonds gegenüber dem Euro lieferte einen positiven Beitrag zur relativen Wertentwicklung, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar abgewertet wurde.

» Eine Übergewichtung brasilianischer Unternehmen und quasi-staatlicher Emittenten sowie lokaler brasilianischer Zinsen belastete die Wertentwicklung, da lokale brasilianische Zinssätze und Kreditrisikoprämien auf brasilianische Staatsanleihen während des Berichtszeitraums anstiegen.

# PIMCO Dividend and Income Builder Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (9,90 %) | (3,28 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2011) | (9,91 %) | 5,97 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (10,22 %) | (3,59 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (10,20 %) | (3,60 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (11,10 %) | (4,55 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2012) | (11,15 %) | 2,91 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (11,48 %) | (4,32 %) |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (11,39 %) | (4,24 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2011) | (9,13 %) | 6,86 % |
| 75 % MSCI All Country World Index Net USD/25 % Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index | (2,40 %) | 0,57 % [2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Feb. 2013) | (9,77 %) | 2,11 % |
| 75 % MSCI All Country World Index/25 % Barclays Global Aggregate Index; alle in CHF besichert | (0,12 %) | 7,17 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (7,99 %) | 0,10 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2012) | (8,12 %) | 6,35 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Juli 2013) | (8,36 %) | 2,62 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (9,30 %) | (1,29 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2012) | (9,29 %) | 4,90 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | — | (2,30 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (9,52 %) | (5,55 %) |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (9,54 %) | (5,55 %) |
| 75 % MSCI All Country World Index/25 % Barclays Global Aggregate Index; alle in EUR besichert | 0,80 % | 4,53 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Class R GBP (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (5,06 %) | 5,98 % |
| 75 % MSCI All Country World Index/25 % Barclays Global Aggregate Index; alle in GBP besichert | 3,26 % | 8,67 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Das Anlageziel des PIMCO Dividend and Income Builder Fund besteht darin, einen laufenden Ertrag zu erzielen, der über der durchschnittlichen Rendite globaler Aktien liegt, um im Laufe der Zeit für die einzelnen Aktien einen laufenden Ertragsstrom und langfristigen Kapitalzuwachs zu erreichen. Zu diesem Zweck wird mindestens 80 % des Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio ertragsbringender Wertpapiere angelegt, wobei üblicherweise mindestens 50 % des Nettovermögens in Aktienwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) und aktienähnliche Wertpapiere investiert werden. Zu den Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren, in die der Teilfonds investieren darf, zählen Stamm- und Vorzugsaktien sowie Wertpapiere, die in Stamm- oder Vorzugsaktien umgewandelt werden können, ebenso wie Wertpapiere, die von börsennotierten Immobilienfonds ('REITs') ausgegeben wurden. Zu den wandelbaren Wertpapieren können Anleihen, Wechsel und Schuldscheine zählen, die zu einem festen oder noch zu bestimmenden Wandlungsverhältnis umgewandelt oder umgetauscht werden können. Des Weiteren kann der Teilfonds auch in von börsennotierten REITs emittierte Wertpapiere, Hinterlegungsscheine wie ADR und GDR, Bezugsrechtsemissionen und strukturierte Schuldverschreibungen, wie aktiengebundene Schuldverschreibungen, aktiengebundene Wertpapiere und P-Notes investieren.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung belastete die relative Wertentwicklung, da sich Small Cap-Werte während des Berichtszeitraums schwächer entwickelten als der MSCI All Country World Index.

» Die Beteiligungen des Teilfonds an Rentenwerten entwickelten sich stärker als seine Rentenwert-Benchmark, der Barclays Global Aggregate USD Unhedged Index, und wirkten sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, was vor allem einer Untergewichtung des Euro während des Berichtszeitraum zuzuschreiben war.

# Emerging Asia Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juni 2011) | (5,31 %) | (1,23 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Juni 2010) | (6,15 %) | 2,81 % |
| [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR] | (5,53 %) | (0,22 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Okt. 2010) | 5,48 % | 5,28 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Juni 2011) | 4,63 % | 4,46 % |
| [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR]. (EUR Unhedged) | 3,48 % | 5,37 % [2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. März 2011) | (6,17 %) | (0,79 %) |
| [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR]. (HKD Unhedged) | (5,62 %) | 1,08 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Emerging Asia Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds legt in einen Mix aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten, ausgenommen Japan, verbunden sind, Derivaten (wie im Verkaufsprospekt definiert) auf diese Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen an. Vom Teilfonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit Caa oder von S&P mit CCC oder von Fitch gleichwertig bewertet (oder die, falls sie kein Rating haben, nach Meinung der Anlageberatungsgesellschaft eine vergleichbare Qualität aufweisen). Ausgenommen davon sind hypothekarisch gesicherte Wertpapiere, für die es kein vorgeschriebenes Mindest-Kreditrating gibt.

» Eine Übergewichtung von Schuldtiteln in China, die vom allgemeinen Kreditindex für Asien abwichen und sich überdurchschnittlich entwickelten, hatte eine überdurchschnittliche Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zur Folge.

» Eine Übergewichtung des mexikanischen Peso, der sich gegenüber der Benchmark unterdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

» Ein taktisches Engagement bei brasilianischen Zinsprodukten in Landeswährung waren der Wertentwicklung abträglich, da sich die Zinsen Brasiliens während des Berichtszeitraums erhöhten.

# Emerging Local Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Dez. 2007) | (16,44 %) | 0,57 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2008) | (16,44 %) | 0,12 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Aug. 2010) | (16,77 %) | (3,87 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Nov. 2008) | (17,27 %) | 2,94 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Juli 2010) | (17,32 %) | (3,62 %) |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (16,57 %) | (10,51 %) |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (16,55 %) | (10,50 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (15,76 %) | 4,71 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | (14,92 %) | 1,27 % [2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile Auflegung: 19. Okt. 2012) | (15,81 %) | (7,77 %) |
| Investor CHF (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2011) | (16,13 %) | (3,24 %) |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (CHF Unhedged) | (14,29 %) | (6,34 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Apr. 2010) | (7,00 %) | 1,08 % |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Juni 2010) | (6,88 %) | (0,24 %) |
| Investor EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2011) | (7,29 %) | 0,08 % |
| Administrative EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2010) | (7,44 %) | (0,58 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Juli 2009) | (7,88 %) | 3,35 % |
| Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (6,94 %) | 0,17 % |
| Class G Retail EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2010) | (7,78 %) | (1,13 %) |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | (5,23 %) | 2,04 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Juni 2008) | (11,65 %) | 4,61 % |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Aug. 2008) | (11,64 %) | 3,53 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | (9,99 %) | 5,32 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung des mexikanischen Peso, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung des polnischen Zloty, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Untergewichtung von Zinsprodukten in der Landeswährung Russlands, die während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

» Eine Untergewichtung des ungarischen Forint, der während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitt, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

» Eine Untergewichtung von Zinsprodukten in der Landeswährung Nigerias, die während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

# Emerging Markets 2018 Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,79 % | 1,03 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Dez. 2014) | 3,84 % | 2,84 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,49 % | 0,69 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,98 % | 0,26 % |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,79 % | 1,03 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,57 % | (0,09 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 1,75 % | (0,86 %) |
| Class S CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,57 % | (0,09 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,49 % | 0,69 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,08 % | 0,26 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,88 % | 0,09 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,57 % | (0,26 %) |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 2014) | 2,57 % | (0,17 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 2,16 % | (0,60 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2014) | 3,69 % | 0,94 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Emerging Markets 2018 Fund möchte in Übereinstimmung mit einer umsichtigen Anlageverwaltung und dem Fälligkeitsdatum des Fonds eine maximale Gesamtrendite erzielen (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds am oder um den 30. November 2018 definiert), indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Nettovermögens in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Laufzeiten und von Emittenten anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenländern verbunden sind und die von deren Regierungen, Behörden oder Organen und Unternehmen ausgegeben werden. Diese Instrumente können auf andere Währungen als den USD lauten, unter anderem auf Währungen von Schwellenmärkten. Die Anlageberatungsgesellschaften können das gewünschte Engagement durch direkte Anlagen in Rentenwerte und/oder durch Anlagen in Derivate erreichen, wie im Verkaufsprospekt näher erläutert. Der Teilfonds kann außerdem in Wertpapiere anlegen, die nicht mit Schwellenländern verbunden sind. Während der zwölf Monate vor dem Fälligkeitsdatum des Fonds können die Anlageberatungsgesellschaften in ihrem Ermessen entscheiden, dass es nicht im besten Interesse des Teilfonds ist, mit Schwellenländern verbundene Rentenwerte zu erwerben (z.B. bei ungünstigen Marktbedingungen). Unter diesen Umständen und nur während des letzten Zwölf-Monats-Zeitraums können die Anlageberatungsgesellschaften die Anlage in nicht mit Schwellenländern verbundene Rentenwerte durchführen; sie sind dann nicht an die oben genannte Beschränkung von 80 % gebunden. Die Laufzeit von während dieses Zeitraums gekaufter Rentenwerte ist jedoch nicht länger als das Fälligkeitsdatum des Teilfonds.

» Engagements bei russischen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Kurse russischer Anleihen während des Berichtszeitraums generell anzogen.

» Ein Engagement bei Unternehmensanleihen und Anleihen quasi-staatlicher Körperschaften aus Kasachstan wirkte sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Anleihenkurse in Kasachstan während des Berichtszeitraums stiegen.

» Beteiligungen an Unternehmensanleihen aus der Türkei wirkten sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Kurse türkischer Unternehmensanleihen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Engagements bei Anleihen quasi-staatlicher Körperschaften und bei Unternehmensanleihen aus China wirkten sich positiv auf die absolute Wertentwicklung aus, da die Preise chinesischer Unternehmensanleihen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Engagement bei brasilianischen Unternehmensanleihen belastete die absolute Wertentwicklung, da die Preise brasilianischer Anleihen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

# Emerging Markets Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2001) | (2,70 %) | 9,53 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2001) | (2,70 %) | 8,63 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. April 2002) | (3,04 %) | 7,73 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2002) | (3,06 %) | 7,68 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Mai 2003) | (3,21 %) | 6,26 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (3,56 %) | 4,66 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (3,54 %) | 4,90 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Okt. 2002) | (2,84 %) | 9,09 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (3,49 %) | 2,26 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (3,58 %) | (1,44 %) |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,81 %) | (2,16 %) |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,84 %) | (2,15 %) |
| Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Feb. 2012) | (1,98 %) | 2,23 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (1,97 %) | 9,91 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 1,23 % | 8,87 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class M Retail AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Dez. 2012) | (1,73 %) | (1,09 %) |
| JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged) | 3,12 % | 1,99 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2005) | (3,89 %) | 4,15 % |
| JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged) | (0,12 %) | 5,12 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2002) | (3,09 %) | 7,84 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. Dez. 2010) | (3,11 %) | 3,15 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Aug. 2009) | (3,46 %) | 5,07 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (3,96 %) | 4,05 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (3,24 %) | (2,46 %) |
| JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged) | 0,75 % | 8,18 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Feb. 2004) | (2,68 %) | 6,92 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (2,70 %) | 5,52 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,89 %) | (2,10 %) |
| JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) | 1,25 % | 7,83 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2007) | (2,93 %) | 3,44 % |
| JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged) | 2,08 % | 5,83 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung russischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung kasachischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, war der Wertentwicklung zuträglich.

» Eine Übergewichtung brasilianischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums gegenüber dem Index unterdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Untergewichtung argentinischer Anleihen, die während des Berichtszeitraums gegenüber den Märkten überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

» Eine Untergewichtung ukrainischer Anleihen, die über des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

# Emerging Markets Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Nov. 2009) | (4,73 %) | 3,68 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. Juli 2013) | (4,78 %) | (1,22 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (5,10 %) | (2,29 %) |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2012) | (5,23 %) | (0,92 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Feb. 2012) | (5,55 %) | 0,13 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 6. Nov. 2012) | (5,57 %) | (2,68 %) |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | (4,72 %) | (2,35 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Dez. 2009) | (3,58 %) | 4,82 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 1,18 % | 6,23 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2012) | (5,99 %) | (1,36 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2012) | (6,86 %) | (0,62 %) |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged) | (0,33 %) | 2,08 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Feb. 2010) | (5,13 %) | 3,17 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (5,43 %) | (2,56 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. März 2010) | (5,95 %) | 1,99 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (5,08 %) | (2,19 %) |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | (5,12 %) | (2,54 %) |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged) | 0,70 % | 5,69 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Juni 2011) | (4,70 %) | 1,46 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (4,58 %) | (1,74 %) |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (GBP Hedged) | 1,21 % | 4,53 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung russischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung kasachischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, war der Wertentwicklung zuträglich.

» Eine Übergewichtung brasilianischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums gegenüber dem Index unterdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung mexikanischer Anleihen während der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung.

» Eine Untergewichtung südkoreanischer Anleihen, die während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

# Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Sept. 2006) | (7,51 %) | 1,60 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Nov. 2008) | (8,34 %) | 0,86 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Okt. 2006) | (8,34 %) | 0,48 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (7,59 %) | (5,50 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juli 2012) | (6,75 %) | (2,72 %) |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) | (7,61 %) | 2,03 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2010) | 3,02 % | 3,03 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Juli 2009) | 2,12 % | 2,92 % |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged) | 2,91 % | 2,67 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung der indischen Rupie, die sich gegenüber der Benchmark überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Eine Übergewichtung des US-Dollars, der sich gegenüber der Benchmark überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Eine Untergewichtung des malaysischen Ringgit, der sich gegenüber der Benchmark unterdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Eine Untergewichtung des thailändischen Baht, der gegenüber der Benchmark überdurchschnittlich abschnitt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

» Eine Untergewichtung des chinesischen Yuan, der gegenüber der Benchmark überdurchschnittlich abschnitt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

# Euro Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 1998) | 0,62 % | 4,92 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Jan. 2003) | 0,67 % | 4,86 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2002) | 0,23 % | 4,87 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 29. April 2002) | 0,28 % | 4,84 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Juni 2001) | 0,10 % | 4,68 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,29 %) | 3,77 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2005) | (0,25 %) | 3,30 % |
| Class G Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,53 % | 5,31 % |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2013) | 0,53 % | 6,28 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (0,69 %) | 1,04 % |
| Citi Euro Broad Investment-Grade Index | 1,07 % | 4,82 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2006) | (0,37 %) | 3,77 % |
| Citi Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index | (0,05 %) | 4,14 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung der Duration (oder der sensiblen Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) in europäischen Kernländern während der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die 10-jährigen europäischen Renditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Eine Übergewichtung von Anleihen der Peripherie-länder, insbesondere von italienischen Anleihen, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Spreads italienischer Anleihen gegenüber den Renditen auf deutsche Bundesanleihen zurückgingen.

» Die Titelauswahl bei der Einrichtung von Short-Positionen auf US-Duration war der Rendite abträglich, da sich die Spreads von Zinsswaps gegenüber US-Schatztiteln während des Berichtszeitraums verengten.

» Short-Engagements beim Euro waren der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Eine Untergewichtung der Sektoren für Energie und Rohstoffe wirkte sich positiv auf die Rendite aus, da diese Sektoren durch rückläufige Rohstoffpreise während des Berichtszeitraums unter Druck kamen.

» Ein Engagement bei brasilianischen Zinsprodukten in Landeswährung belastete die relative Rendite, da die Renditen auf Anleihen in Lokalwährung während des Berichtszeitraums stark anstiegen.

# Euro Credit Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2008) | 0,34 % | 4,97 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013) | 0,31 % | 4,46 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2010) | (0,48 %) | 3,79 % |
| Barclays Euro-Aggregate Credit Index | (0,34 %) | 4,93 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung des Bankensektors, der besser abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Übergewichtung von verbrieften Papieren, die positive Renditen erzielten, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Untergewichtung des Lebensmittel- und Getränkesektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Übergewichtung des Metall- und Bergbausektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

# Euro Income Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 0,62 % | 5,47 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 0,60 % | 5,46 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (29. Mai 2012) | 0,18 % | 5,78 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2011) | (0,32 %) | 4,51 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung, 28. Feb. 2011) | (0,33 %) | 4,51 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (0,71 %) | (1,60 %) |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (0,62 %) | (1,51 %) |
| Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index | 0,88 % | 4,85 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Euro Income Bond Fund beabsichtigt, seine laufenden Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der langfristige Kapitalzuwachs gilt als sekundäres Anlageziel. Der Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Anleihen und anderen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

» Ein Engagement bei Duration (oder die sensible Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) in Europa, unter anderem in Deutschland, Spanien und Italien, war der Wertentwicklung zuträglich, da die Politik der Europäischen Zentralbank eine Absenkung der Renditen am vorderen Ende der Kurve nach sich zog und den Spreads der Peripherieländer Unterstützung bot. Engagements bei der australischen Duration waren der Wertentwicklung ebenfalls zuträglich, da die Renditen von australischen Anleihen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Schwellenmarktengagements, vor allem bei russischen Auslandsschulden, wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich Kreditwerte während des Berichtszeitraums angesichts einer gestiegenen Zuversicht unter Anlegern hervorragend entwickelten.

» Engagements bei Verbriefte Schuldverschreibungen, insbesondere bei US-amerikanischen Non-Agency-RMBS leisteten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, was vor allem Verbesserungen am US-Immobilienmarkt während des Berichtszeitraums zu verdanken war.

» Engagements bei Werten mit Investment Grade waren der Wertentwicklung während des Berichtszeitraums insgesamt abträglich. Zugewinne aus unseren Positionen bei Finanzwerten wurden durch Engagements bei Schuldtiteln aus den Bereichen Energie sowie Metalle und Bergbau ausgeglichen, da diese unter dem verlangsamten Wachstum in China und dem Einbruch der Rohstoffpreise litten.

» Engagements bei Hochzinsanleihen wirkten sich knapp negativ auf die Wertentwicklung aus, was vor allem Engagements bei ausgewählten längerfristigen durch Immobilien besicherten Anleihen während des Berichtszeitraums zuzuschreiben war.

# Euro Long Average Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. April 2006) | (1,76 %) | 8,09 % |
| Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | (0,55 %) | 6,83 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Euro Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. » Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

» Engagements bei langfristigen Staatsanleihen der europäischen Kernländer waren der absoluten Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Die Positionierung bezüglich der Zinsstrukturkurven für Staatsanleihen europäischer Kernländer belastete die relative Wertentwicklung, da diese Kurven während des Berichtszeitraums steiler wurden.

» Beteiligungen an Staatsanleihen europäischer Peripherieländer, beispielsweise von Italien und Spanien, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Sätze für diese Länder während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Engagements beim US-Dollar wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert zulegte.

» Eine Allokation in Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums vergrößerten.

» Ein Short-Engagement beim japanischen Yen war der Wertentwicklung abträglich, da diese Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert gewann.

# Euro Low Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Juli 2011) | (0,62 %) | 2,62 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. März 2013) | (1,55 %) | 0,47 % |
| Barclays Euro Aggregate ex-Treasury 1-3 Year Index | 0,47 % | 2,45 % [2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Nov. 2015) | — | (0,40 %) |
| Barclays Euro Aggregate ex-Treasury 1-3 Year Index (AUD Hedged) | — | 0,48 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Euro Low Duration Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolio-Duration des Teilfonds liegt grundsätzlich innerhalb eines Bereichs von etwa zwei Jahren über oder unter der Duration des Barclays Euro Aggregate ex-Treasury 1-3 Year Index.

» Eine Übergewichtung von Italien und Slowenien wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da sich die Spreads auf Staatsanleihen der Peripherieländer während des Berichtszeitraums verengten.

» Eine Übergewichtung des US-Dollars trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert zulegte.

» Die Beteiligung an gedeckten Anleihen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums einen höheren Ertrag erzielten als die Benchmark.

» Eine Untergewichtung des längeren Endes der deutschen Renditekurve war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Renditen in diesem Teil der Renditekurve während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Engagement bei griechischen Staatsanleihen während der ersten Hälfte des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung.

» Die Auswahl von Emissionen innerhalb des europäischen Finanzsektors belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte Wertpapiere während des Berichtszeitraums starke Kurseinbrüche hinnehmen mussten.

# Euro Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2006) | 2,29 % | 3,00 % |
| Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond Index | 2,07 % | 2,86 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Euro Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Realrendite erzielen. Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden inflationsgekoppelten Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden.

» Ein Engagement bei deutschen inflationsgebundenen Anleihen war der Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich, da die Realrenditen während des ersten Quartals stark zulegten. Im Zuge des Anstiegs der Realrenditen wurde das Engagement reduziert.

» Ein Engagement bei französischen inflationsgebundenen Anleihen war der Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich, da die Realrenditen während des ersten Quartals stark zulegten. Im Zuge des Anstiegs der Realrenditen wurde das Engagement reduziert.

» Engagements bei italienischen inflationsgebundenen Anleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Short-Engagements bei 20- und 30-jährigen deutschen Nominalzinsen belasteten die Wertentwicklung im ersten Quartal 2015, da die Renditen stark anstiegen.

# Euro Short-Term Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2006) | 0,16 % | 2,05 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,52 %) | 1,29 % |
| 1 Month Euribor Index | (0,06 %) | 1,46 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung der Duration (oder der sensiblen Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) in Italien und Slowenien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von Staatsanleihen der Randstaaten während des Berichtszeitraums verengten.

» Eine Übergewichtung des US-Dollars trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert zulegte.

» Die Beteiligung an gedeckten Anleihen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums einen höheren Ertrag erzielten als die Benchmark.

» Ein Engagement bei griechischen Staatsanleihen während des ersten Quartals des Berichtszeitraums belastete die relative Wertentwicklung.

» Die Auswahl von Emissionen innerhalb des europäischen Finanzsektors belastete die Wertentwicklung, da ausgewählte Wertpapiere während des Berichtszeitraums starke Kurseinbrüche hinnehmen mussten.

# Euro Ultra-Long Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Jan. 2007) | (4,78 %) | 12,19 % |
| Barclays 20 Yr, 25 Yr, 30 Yr and 35 Yr Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index | (3,22 %) | 12,03 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Euro Ultra Long Duration Fund beabsichtigt, seine Gesamterträge in Übereinstimmung mit den angegebenen Durationszielen und angemessener Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf Euro lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) an. Unter normalen Marktbedingungen entfallen mindestens zwei Drittel der Duration des Teilfonds auf Engagements bei auf Euro lautenden staatlichen und/oder regierungsnahen Rentenwerten. Zur vorsorglichen Klarstellung gilt, dass hierzu auch auf Euro lautende Zinsswaps zählen. Die durchschnittliche Portfolioduration des Teilfonds kann zwischen zwei Jahren (plus oder minus) einer Mischung des Barclays 20 Year, 25 Year, 30 Year, and 35 Year Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index mit einer Gewichtung von 50 %/30 %/15 %/5 % betragen.

» Engagements bei langfristigen europäischen Swap-Sätzen waren der absoluten Wertentwicklung abträglich, da europäische Swap-Sätze während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Die Positionierung bezüglich der europäischen Swap-Kurve war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Kurve während des Berichtszeitraums steiler wurde.

» Beteiligungen an Staatsanleihen europäischer Peripherieländer, insbesondere von Portugal und Slowenien, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Sätze für diese Länder während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Engagements beim US-Dollar wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro an Wert zulegte.

» Während der ersten Hälfte des Jahres war das Engagement bei polnischen Zinssätzen der Wertentwicklung abträglich, da diese Zinsen während des Berichtszeitraums allgemein zurückgingen.

» Allokationen auf verbriefte Anlagen belasteten die Wertentwicklung, da sich diese Anlageklasse während des Berichtszeitraums schwach entwickelte.

» Short-Engagements bei ausgewählten Währungen von Industrieländern, beispielswiese beim Schweizer Franken im ersten Quartal oder beim japanischen Yen, belasteten die Wertentwicklung, da diese Währungen gegenüber dem Euro an Wert zulegten.

# Global Advantage Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Juni 2009) | (6,22 %) | 2,70 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2010) | (7,12 %) | (0,44 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2010) | (7,19 %) | (0,45 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 6. Sept. 2011) | (5,53 %) | (0,68 %) |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) | (5,51 %) | 2,50 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Aug. 2011) | (3,52 %) | 2,34 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close) | (2,90 %) | 2,28 % |
| **Auf DKK lautende Klassen** | | |
| Institutional DKK (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. März 2013) | (0,78 %) | 0,68 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (DKK, Partially Hedged) (London Close) | (0,03 %) | 0,77 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Mai 2010) | (0,50 %) | 3,34 % |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 6. Mai 2010) | (1,47 %) | 2,31 % |
| Class T EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (1,90 %) | (1,52 %) |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close) | 0,30 % | 3,27 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Juli 2012) | (1,42 %) | 1,14 % |
| Class R GBP (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,55 %) | 0,52 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close) | (0,53 %) | 1,33 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. März 2012) | 1,99 % | 5,03 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close) | 2,85 % | 5,15 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Untergewichtung des Euro und des brasilianischen Real waren der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Eine Untergewichtung der Sektoren für Energie und Rohstoffe war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums erweiterten.

» Die Beteiligung an Non-Agency-MBS wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums einen höheren Ertrag erzielten als die Benchmark.

» Die Titelauswahl bei Zinsswaps zur Einrichtung einer Short-Position auf US-Duration war der Rendite abträglich, da sich Zinsswaps während des Berichtszeitraums stärker entwickelten als US-Schatztitel.

» Die Untergewichtung der kanadischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Eine Übergewichtung lokaler brasilianischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums über die gesamte Kurve hinweg anstiegen.

» Die Titelauswahl am brasilianischen Markt für Titel quasi-staatlicher Körperschaften aus Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da sich die externen Spreads der Schwellenländer während des Berichtszeitraums erweiterten.

# Global Advantage Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Juli 2011) | (12,70 %) | (4,07 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (13,42 %) | (8,63 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 8. Nov. 2012) | (12,11 %) | (6,41 %) |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged) | (10,64 %) | (3,08 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. März 2012) | (10,33 %) | (1,69 %) |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (CHF Partial Hedged) | (8,24 %) | (0,72 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Juli 2011) | (6,19 %) | 0,67 % |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 5. März 2013) | (6,15 %) | (3,63 %) |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 7. Mai 2015) | — | (7,26 %) |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Apr. 2012) | (6,50 %) | (0,98 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Dez. 2012) | (6,99 %) | (3,70 %) |
| Class G Institutional EUR (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (6,20 %) | 0,20 % |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (EUR Partial Hedged) | (3,92 %) | 1,74 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2012) | (7,69 %) | (1,59 %) |
| Investor GBP (Partially Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. April 2012) | (8,05 %) | (1,85 %) |
| Class R GBP (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (7,91 %) | (3,76 %) |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (GBP Partial Hedged) | (5,48 %) | (0,56 %)[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Global Advantage Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Nettovermögens in internationale, inflationsindexierte Rentenwerte in Landeswährung aus Industrie- und Schwellenmärkten anlegt (wie im Verkaufsprospekt definiert).

» Eine Übergewichtung italienischer inflationsgebundener Anleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Eine Untergewichtung brasilianischer inflationsgebundener Anleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da Realrenditen während des Berichtszeitraums abverkauft wurden.

» Ein Engagement bei brasilianischen nominellen Zinssätzen war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Eine Übergewichtung von US Treasury Inflation-Protected Securities war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

# Global Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. März 1998) | 0,91 % | 5,91 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2001) | 0,84 % | 5,62 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. März 1999) | 0,54 % | 5,38 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Jan. 2001) | 0,50 % | 5,25 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Juni 2004) | 0,39 % | 5,12 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | 0,00 % | 4,74 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (0,01 %) | 4,63 % |
| Class G Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Apr. 2015) | — | (2,00 %) |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002) | 0,70 % | 5,33 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,65 % | 2,77 % |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Okt. 2013) | 0,91 % | 4,59 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (0,29 %) | 1,16 % |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (0,25 %) | 1,16 % |
| Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index | 1,02 % | 5,14 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional USD (Unhedged Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2002) | (3,32 %) | 5,22 % |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. März 2006) | (3,31 %) | 4,95 % |
| Investor USD (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2005) | (3,65 %) | 3,87 % |
| Class E USD (Currency Exposure), thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2010) | (4,19 %) | 2,77 % |
| Class E USD (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2010) | (4,21 %) | 2,75 % |
| Class R USD (Currency Exposure), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (3,57 %) | (1,78 %) |
| Class Z USD (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (2,76 %) | 7,33 % |
| Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index | (3,15 %) | 4,29 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2003) | (0,64 %) | 3,79 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. April 2003) | (0,64 %) | 3,85 % |
| Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Juni 2011) | (0,97 %) | 4,51 % |
| Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index | (0,52 %) | 2,84 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. April 2003) | 0,48 % | 5,06 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. April 2005) | 0,44 % | 5,12 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Feb. 2005) | 0,12 % | 4,72 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,47 %) | 4,57 % |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Dez. 2012) | (0,42 %) | 1,91 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,19 % | 2,53 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (0,78 %) | 1,12 % |
| Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index | 0,68 % | 4,06 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013) | 7,66 % | 6,40 % |
| Barclays Global Aggregate (EUR Unhedged) Index | 7,88 % | 6,33 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2003) | 1,15 % | 6,02 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Juni 2004) | 1,17 % | 6,19 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. April 2005) | 0,81 % | 5,50 % |
| Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Feb. 2007) | 0,66 % | 5,79 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Nov. 2009) | 0,26 % | 5,46 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,91 % | 3,02 % |
| Class S GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | 1,18 % | 4,98 % |
| Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index | 1,39 % | 5,10 %[2] |

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung der Duration (oder der sensiblen Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) in Italien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von Staatsanleihen dieses Randstaats während des Berichtszeitraums gegenüber den Renditen auf deutsche Bundesanleihen verengten.

» Eine Untergewichtung des Euro und des brasilianischen Real waren der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Eine Untergewichtung der Sektoren für Energie und Rohstoffe war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums erweiterten.

» Die Beteiligung an Non-Agency-MBS wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums einen höheren Ertrag erzielten als die Benchmark.

» Die Titelauswahl bei Zinsswaps zur Einrichtung einer Short-Position auf US-Duration war der Rendite abträglich, da sich Zinsswaps während des Berichtszeitraums stärker entwickelten als US-Schatztitel.

» Die Untergewichtung der kanadischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Eine Übergewichtung lokaler brasilianischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums über die gesamte Kurve hinweg anstiegen.

» Die Titelauswahl am brasilianischen Markt für Titel quasi-staatlicher Körperschaften aus Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da sich die externen Spreads der Schwellenländer während des Berichtszeitraums erweiterten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010) | 0,71 % | 6,29 % |
| Barclays Global Aggregate (ILS Hedged) Index | 0,85 % | 4,66 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005) | 1,78 % | 6,24 % |
| Investor NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. Juli 2006) | 1,43 % | 6,70 % |
| Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index | 2,02 % | 5,16 % [2] |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Nov. 2004) | 4,12 % | 8,71 % |
| Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index | 4,46 % | 7,61 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Nov. 2004) | 0,34 % | 5,47 % |
| Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index | 0,53 % | 4,35 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Aug. 2009) | 1,59 % | 6,86 % |
| Barclays Global Aggregate (SGD Hedged) Index | 2,16 % | 4,39 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# Global Bond Ex-US Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2003) | 0,72 % | 5,37 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Nov. 2005) | 0,78 % | 5,74 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2006) | 0,37 % | 5,33 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Sept. 2004) | 0,22 % | 5,24 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2008) | (0,16 %) | 5,33 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,54 % | 3,89 % |
| Citi World Government Bond Ex-US Index (USD Hedged) | 1,55 % | 4,25 % [2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. April 2006) | 0,32 % | 5,86 % |
| Citi World Government Bond Ex-US Index (EUR Hedged) | 1,27 % | 4,32 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung der Duration (oder der sensiblen Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) in Italien trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads von Staatsanleihen dieses Randstaats während des Berichtszeitraums gegenüber den Renditen auf deutsche Bundesanleihen verengten.

» Eine Untergewichtung des Euro und des brasilianischen Real waren der relativen Wertentwicklung zuträglich, da die Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Eine Übergewichtung australischer Duration während des ersten Quartals trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Die Beteiligung an Non-Agency-MBS wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums einen höheren Ertrag erzielten als die Benchmark.

» Die Titelauswahl bei Zinsswaps zur Einrichtung einer Short-Position auf US-Duration war der Rendite abträglich, da sich Zinsswaps während des Berichtszeitraums stärker entwickelten als US-Schatztitel.

» Die Untergewichtung der kanadischen Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Eine Übergewichtung lokaler brasilianischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums über die gesamte Kurve hinweg anstiegen.

» Die Titelauswahl am brasilianischen Markt für Titel quasi-staatlicher Körperschaften aus Schwellenländern war der Wertentwicklung abträglich, da sich die externen Spreads der Schwellenländer während des Berichtszeitraums erweiterten.

# PIMCO Global Dividend Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (9,00 %) | (2,54 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2011) | (8,90 %) | 6,67 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (9,32 %) | (2,91 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (9,25 %) | (2,90 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (10,28 %) | (3,91 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2012) | (10,14 %) | 3,48 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2011) | (8,23 %) | 7,57 % |
| MSCI All Country World Index | (2,36 %) | 1,12 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2012) | (6,19 %) | 7,30 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2011) | (6,16 %) | 9,02 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Jan. 2014) | (7,40 %) | 0,66 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2011) | (7,46 %) | 7,51 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (6,23 %) | 1,95 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (7,77 %) | (3,05 %) |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (7,73 %) | (2,98 %) |
| MSCI All Country World Index (EUR Hedged) | 0,63 % | 10,89 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO Global Dividend Fund ist bestrebt, laufende Erträge, die über der durchschnittlichen Rendite internationaler Aktien liegen, sowie ein langfristiges Kapitalwachstum zu erzielen. Zu diesem Zweck legt der Teilfonds in Aktientitel (wie im Verkaufsprospekt definiert) und aktienähnliche Wertpapiere an, sowie in Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten und entsprechende derivative Finanzinstrumente, denen solche Wertpapiere zugrunde liegen. Der Teilfonds investiert grundsätzlich mindestens drei Viertel seines Nettovermögens in Aktientitel und aktienähnliche Wertpapiere. Zu den Aktien, in die der Teilfonds investieren darf, zählen Stamm- und Vorzugsaktien sowie Wertpapiere, die in Stamm- oder Vorzugsaktien umgewandelt werden können. Zu den wandelbaren Wertpapieren können Anleihen, Wechsel und Schuldscheine zählen, die zu einem festen oder noch zu bestimmenden Wandlungsverhältnis umgewandelt oder umgetauscht werden können. Der Teilfonds kann in von börsennotierten Immobilienfonds (REITs) emittierte Wertpapiere, Hinterlegungsscheine wie ADR und GDR, Bezugsrechtsemissionen und strukturierte Schuldverschreibungen, wie aktiengebundene Schuldverschreibungen, aktiengebundene Wertpapiere und P-Notes investieren.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung belastete die relative Wertentwicklung, da sich Small Cap-Werte während des Berichtszeitraums deutliche schwächer entwickelten als der MSCI All Country World Index.

» Nippon Telegraph and Telephone Corporation leistete den größten Beitrag zur relativen Wertentwicklung des Teilfonds, während Tronox Ltd. die relative Wertentwicklung des Teilfonds während des Berichtszeitraums am stärksten belastete.

# Global High Yield Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005) | (0,61 %) | 6,63 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (0,56 %) | 6,69 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 27. Juni 2008) | (1,05 %) | 6,53 % |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Dez. 2015) | — | 0,51 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006) | (1,47 %) | 5,64 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006) | (1,37 %) | 5,76 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Aug. 2008) | (0,78 %) | 7,14 % |
| Class H Institutional, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. März 2013) | (0,76 %) | 2,17 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2010) | (1,43 %) | 4,94 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (1,38 %) | 0,41 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,81 %) | 3,08 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,90 %) | 3,05 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (1,79 %) | (0,91 %) |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (1,97 %) | (0,98 %) |
| BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD | (1,62 %) | 6,84 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Feb. 2010) | (1,79 %) | 6,23 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Aug. 2012) | (1,81 %) | 3,47 % |
| BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF | (3,07 %) | 6,44 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Mai 2008) | (0,97 %) | 6,30 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (0,94 %) | 6,30 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Jan. 2011) | (1,24 %) | 4,85 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 4. Aug. 2010) | (1,51 %) | 5,41 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (1,81 %) | 5,22 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | — | (3,00 %) |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. März 2012) | (1,84 %) | 3,68 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,18 %) | 2,80 % |
| BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR | (2,04 %) | 6,78 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2012) | (0,49 %) | 5,53 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (0,61 %) | 6,88 % |
| Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Juli 2010) | (1,06 %) | 5,98 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Juni 2009) | (1,39 %) | 8,46 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,71 %) | 3,28 % |
| BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP | (1,62 %) | 5,73 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Feb. 2007) | 0,22 % | 7,31 % |
| BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into NOK | (1,01 %) | 7,17 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Untergewichtung des Energiesektors war der relativen Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums hinter dem High-Yield-Anleihemarkt insgesamt zurückblieb.

» Eine Untergewichtung des Metall- und Bergbausektors war der relativen Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums hinter dem High-Yield-Anleihemarkt insgesamt zurückblieb.

» Eine Übergewichtung des Gesundheitssektors war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der High-Yield-Anleihemarkt insgesamt.

» Der untergewichtete Automobilsektor schmälerte die relative Rendite, da dieser Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

» Der untergewichtete Festnetzsektor schmälerte die relative Rendite, da dieser Teilsektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

» Engagements bei mit CCC-bewerteten Titeln waren der Rendite abträglich, da dieser Qualitätsbereich während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

# Global Investment Grade Credit Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2008) | 0,49 % | 6,16 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Juli 2003) | 0,55 % | 5,74 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2005) | 0,16 % | 5,12 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 0,16 % | 7,31 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2009) | 0,00 % | 7,14 % |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2009) | (0,03 %) | 7,13 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2008) | (0,39 %) | 7,08 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2008) | (0,41 %) | 5,11 % |
| Class G Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Apr. 2015) | — | (2,60 %) |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Aug. 2008) | 0,35 % | 6,37 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2012) | (0,39 %) | 1,97 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | (0,29 %) | 2,92 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,19 % | 2,16 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,25 % | 2,19 % |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | 0,47 % | 3,51 % |
| Class S, ausschüttende Anteile (Auflegung: 12. Mai 2014) | 0,46 % | 2,50 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (0,80 %) | (0,25 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | 1,03 % | 8,42 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | 0,13 % | 5,17 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Aug. 2013) | (2,90 %) | 0,93 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged) | (3,55 %) | 0,68 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Dez. 2009) | (0,96 %) | 4,92 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 06. Feb. 2015) | — | (2,44 %) |
| Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Mai 2011) | (1,27 %) | 3,36 % |
| Investor CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (1,21 %) | 6,60 % |
| Administrative CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2013) | (1,43 %) | 1,25 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile, (Auflegung: 6. März 2012) | (1,87 %) | 2,55 % |
| Class S CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | (0,93 %) | 2,68 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged) | (1,68 %) | 3,96 %[2] |
| **Auf CZK lautende Klassen** | | |
| Institutional CZK (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Mai 2015) | — | (1,49 %) |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged) | — | (1,12 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2003) | 0,06 % | 5,48 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Sept. 2008) | 0,15 % | 6,74 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Mai 2006) | (0,24 %) | 5,38 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009) | (0,27 %) | 7,28 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Feb. 2009) | (0,44 %) | 6,91 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 17. Feb. 2009) | (0,40 %) | 6,91 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,82 %) | 4,68 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 9. Sept. 2010) | (0,79 %) | 3,71 % |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. März 2012) | (0,78 %) | 3,12 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,19 %) | 1,91 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,23 %) | 1,89 % |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | 0,09 % | 3,29 % |
| Class S EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2014) | 0,03 % | 0,66 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (1,19 %) | (0,16 %) |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged) | (0,44 %) | 4,28 %[2] |

## Kommentare zum Portfolio

» Der Global Investment Grade Credit Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Unternehmens-Rentenpapieren mit Investment Grade-Qualität (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, deren Emittenten ihren eingetragenen Geschäftssitz oder ihre überwiegende Geschäftstätigkeit in mindestens drei Ländern haben, von denen eines die USA sein können.

» Eine Übergewichtung des Bankensektors, der besser abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Untergewichtung des Versorgungssektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Übergewichtung ausgewählter Titel quasi-staatlicher Körperschaften aus Schwellenländern, die besser abschnitten als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Übergewichtung des unabhängigen Energie- und Explorationssektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Aug. 2012) | 8,13 % | 4,76 % |
| Class G Retail EUR (Currency Exposure), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Juli 2014) | 7,22 % | 10,76 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged) | 7,44 % | 5,20 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Sept. 2005) | 0,73 % | 5,78 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Juli 2008) | 0,81 % | 6,86 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 0,43 % | 7,51 % |
| Administrative GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2009) | 0,26 % | 7,29 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. März 2009) | (0,17 %) | 7,17 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,47 % | 2,42 % |
| Class S GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2014) | 0,76 % | 1,25 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged) | 0,21 % | 4,75 % [2] |
| **Auf HUF lautende Klassen** | | |
| Institutional HUF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. April 2015) | — | (2,51 %) |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (HUF Hedged) | — | (2,06 %) |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010) | 0,22 % | 5,88 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (ILS Hedged) | (0,30 %) | 5,30 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jan. 2012) | 1,38 % | 5,96 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged) | 0,81 % | 5,32 % |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Juli 2011) | 3,67 % | 7,39 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (NZD Hedged) | 3,25 % | 7,03 % |
| **Auf PLN lautende Klassen** | | |
| Institutional PLN (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Juni 2015) | — | 0,96 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (PLN Hedged) | — | 1,33 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Dez. 2009) | (0,07 %) | 6,34 % |
| Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Dez. 2012) | (0,56 %) | 2,06 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged) | (0,58 %) | 5,40 % [2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2011) | 1,28 % | 4,98 % |
| Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015) | — | (0,66 %) |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Juli 2012) | 0,38 % | 2,56 % |
| Barclays Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged) | 0,98 % | 4,62 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# Global Low Duration Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,91 %) | (0,97 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,91 %) | (0,98 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,83 %) | (1,84 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | 0,02 % | (0,70 %) |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (2,33 %) | (1,84 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (3,16 %) | (2,71 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged) | (1,51 %) | (1,70 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,41 %) | (1,29 %) |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,42 %) | (1,30 %) |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 9. Dez. 2014) | (1,38 %) | (2,23 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (2,24 %) | (2,16 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged) | (0,47 %) | (1,03 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,81 %) | (0,81 %) |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (0,81 %) | (0,77 %) |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | (1,12 %) | (1,04 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged) | 0,20 % | (0,49 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung italienischer inflationsgebundener Anleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Eine Untergewichtung 5-jähriger britischer inflationsgebundener Anleihen wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da 5-jährige Realrenditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Eine Übergewichtung von US Treasury Inflation-Protected Securities war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Engagement bei brasilianischen nominellen Zinssätzen war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen während des Berichtszeitraums stiegen.

# Global Multi-Asset Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. April 2009) | (0,90 %) | 5,53 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010) | (1,18 %) | 1,65 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010) | (1,13 %) | 1,65 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2009) | (1,99 %) | 3,78 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Jan. 2011) | (2,08 %) | 0,10 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,09 %) | 0,00 % |
| 60 % MSCI All Country World Index/40 % Barclays Global Aggregate USD Hedged | (0,80 %) | 9,05 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. April 2009) | 1,05 % | 5,65 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Juli 2010) | 1,10 % | 3,17 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. Juli 2009) | 0,71 % | 4,78 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Juni 2009) | (0,15 %) | 3,91 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011) | (0,12 %) | 0,10 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | | 1,10 % |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Sept. 2011) | (0,18 %) | 0,65 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,78 % | 0,96 % |
| 60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged/40 % Barclays Global Aggregate EUR Hedged | 0,85 % | 8,75 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Dez. 2012) | 1,07 % | 1,22 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. April 2010) | 1,10 % | 3,10 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Sept. 2009) | (0,09 %) | 2,56 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,86 % | 1,20 % |
| 60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged/40 % Barclays Global Aggregate GBP Hedged | 1,17 % | 6,49 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Global Multi-Asset Fund strebt bei Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung die maximal mögliche Gesamtrendite an, indem er sich an einem breiten Spektrum von Vermögensklassen beteiligt, einschließlich Aktien, Rentenwerte, Rohstoffe und Immobilien (wie im Verkaufsprospekt beschrieben). Der Teilfonds kann auch in andere PIMCO-Fonds und andere Organismen für gemeinsame Anlagen anlegen.

» Eine Beteiligung am PIMCO Funds: Global Investors Series plc Income Fund wirkte sich positiv auf den Global Multi-Asset Fund aus, da der Income Fund während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der internationale Rentenmarkt.

» Eine Übergewichtung europäischer und japanischer Aktien wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da diese Märkte während des Berichtszeitraums besser abschnitten als die globalen Aktienmärkte.

» Eine Übergewichtung des US-Dollars war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der US-Dollar während des Berichtszeitraums gegenüber den meisten Währungen von Industrieländern an Wert gewann.

» Eine Übergewichtung chinesischer Aktien war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich chinesische während des Berichtszeitraums schwächer entwickelten als die globalen Aktienmärkte.

» Eine Swap-Widener-Position in den USA belastete die Wertentwicklung, da die Spreads auf Swaps während des Berichtszeitraums enger wurden.

# Global Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003) | (1,88 %) | 4,79 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (1,95 %) | 4,31 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. März 2004) | (2,24 %) | 4,18 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (2,29 %) | 5,54 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 17. Dez. 2004) | (2,38 %) | 3,89 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (2,76 %) | 3,66 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (2,77 %) | 3,46 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Mai 2004) | (2,08 %) | 4,61 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,17 %) | (0,19 %) |
| Class S, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2014) | (1,86 %) | 0,91 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | (1,45 %) | 6,31 % |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index | (1,12 %) | 4,65 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. März 2014) | 0,72 % | 5,10 % |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond AUD Hedged Index | 1,22 % | 5,46 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2008) | (3,61 %) | 3,32 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015) | — | (1,60 %) |
| Investor CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (3,96 %) | 4,82 % |
| Class S CHF (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2014) | (3,60 %) | (0,36 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index | (2,73 %) | 3,01 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003) | (2,45 %) | 4,48 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (2,52 %) | 3,99 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 1. Okt. 2013) | (2,49 %) | 1,88 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. April 2004) | (2,84 %) | 3,99 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (2,82 %) | 5,45 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (3,40 %) | 3,39 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,77 %) | (0,59 %) |
| Class S EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2014) | (2,56 %) | 0,43 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (3,66 %) | (2,00 %) |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond Euro Hedged Index | (1,26 %) | 4,23 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Feb. 2004) | (1,70 %) | 5,43 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 27. April 2005) | (1,78 %) | 4,81 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Feb. 2007) | (2,04 %) | 4,95 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Feb. 2009) | (2,06 %) | 5,74 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Juni 2009) | (2,58 %) | 4,57 % |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,96 %) | (0,03 %) |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (1,98 %) | (0,06 %) |
| Class S GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2014) | (1,68 %) | 1,16 % |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index | (0,68 %) | 5,25 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Feb. 2008) | (1,27 %) | 3,65 % |
| Barclays World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index | (0,02 %) | 3,67 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Global Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren unterschiedlicher Laufzeiten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden.

» Eine Untergewichtung französischer inflationsgebundener Anleihen während des zweiten Quartals 2015 sowie in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums leistete einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, da Realrenditen abverkauft wurden.

» Eine Übergewichtung italienischer inflationsgebundener Anleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums stiegen.

» Eine Übergewichtung von US Treasury Inflation-Protected Securities war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Realrenditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Engagement beim brasilianischen nominellen Zinssatz war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen während des Berichtszeitraums nach oben gingen.

# Income Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,93 % | 6,91 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,94 % | 6,93 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Jan. 2015) | — | 2,30 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. April 2013) | 2,55 % | 3,71 % |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,40 % | 6,38 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 1,96 % | 5,97 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,03 % | 5,98 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. April 2015) | — | (0,12 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 1,61 % | 0,83 % |
| Class T, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 1,63 % | 0,84 % |
| Class Z, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 3,48 % | 7,47 % |
| Barclays US Aggregate Index | 0,55 % | 1,36 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2015) | — | (0,33 %) |
| Barclays Global Aggregate (AUD Hedged) Index | — | (0,18 %) |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Dez. 2014) | 1,49 % | 1,93 % |
| Institutional CHF (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Okt. 2015) | — | (1,14 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 0,58 % | 2,28 % |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 0,69 % | 2,32 % |
| Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index | (1,04 %) | (0,72 %)[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Class E RMB (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2013) | 5,26 % | 5,01 % |
| Barclays US Aggregate (CNH Hedged) Index | 4,68 % | 4,70 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,52 % | 6,69 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,57 % | 6,65 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 29. Juli 2014) | 2,57 % | 2,06 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. April 2015) | — | (0,70 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Mai 2015) | — | (0,22 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende A-Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2015) | — | (0,10 %) |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Aug. 2015) | — | (0,30 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 1,63 % | 5,71 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 1,65 % | 5,72 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 2,57 % | 3,63 % |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2013) | 2,61 % | 4,87 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | 1,20 % | 0,64 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | 1,22 % | 0,65 % |
| Barclays US Aggregate (Euro Hedged) Index | 0,19 % | 1,14 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013) | 3,04 % | 4,59 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,85 % | 6,84 % |
| Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index | 0,92 % | 1,63 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Institutional HKD (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (am 30. Okt. 2015 aufgelegt) | — | (0,84 %) |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 4. Feb. 2013) | 1,89 % | 3,49 % |
| Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index | 0,49 % | 1,71 %[2] |

## Kommentare zum Portfolio

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

» Engagements bei Non-Agency-RMBS waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Kurse für diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein anzogen.

» Engagements bei High-Yield-Schuldtiteln belasteten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein negative Gesamtrenditen verbuchten.

» Eine Untergewichtung von Schuldtiteln mit Investment Grade verstärkte die relative Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein negative Renditen verbuchten.

» Ein Engagement bei brasilianischer Duration (oder sensible Reaktion auf Änderungen der Marktzinsen) war der Wertentwicklung abträglich, da brasilianische Zinssätze während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Eine Untergewichtung des Euro war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Euro während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

» Engagements bei auf US-Dollar lautenden Schuldtiteln aus Schwellenländern, vor allem aus Russland, verstärkten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums positive Gesamtrenditen verbuchten.

» Eine Untergewichtung von US-Duration gegenüber dem Benchmarkindex des Teilfonds belastete die relative Wertentwicklung, da hierdurch der Carry im Portfolio während des Berichtszeitraums vermindert wurde.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2015) | — | 0,13 % |
| Administrative SGD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 3,16 % | 6,60 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 19. Feb. 2013) | 2,80 % | 3,73 % |
| Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index | 1,69 % | 1,71 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# Inflation Strategy Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2013) | (8,71 %) | (4,73 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Feb. 2013) | (9,77 %) | (5,88 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung, 14. Feb. 2013) | (9,81 %) | (5,88 %) |
| OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)[2] | 3,46 % | 4,31 % |
| 45 % Global Advantage ILB Index (USD Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index | (8,51 %) | — |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Mai 2013) | (6,54 %) | (3,39 %) |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Apr. 2013) | (6,85 %) | (3,89 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. April 2013) | (6,96 %) | (3,91 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2013) | (7,68 %) | (4,73 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. April 2013) | (7,68 %) | (4,71 %) |
| OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)[2] | 3,46 % | 4,36 % |
| 45 % Global Advantage ILB Index (EUR Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD) (EUR Hdg), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index (EUR Hdg), 10 % Bloomberg Gold Total Return Index (EUR Hdg) | (6,37 %) | — |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Mai 2014) | (7,10 %) | (5,37 %) |
| OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)[2] | 3,46 % | 4,04 % |
| 45 % Global Advantage ILB Index (GBP Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD) (GBP Hdg), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index (GBP Hdg), 10 % Bloomberg Gold Total Return Index (GBP Hdg) | (5,34 %) | — |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) - Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 31. Januar 2013 berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Ein Engagement bei inflationsgebundenen Anleihen war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da diese während des Berichtszeitraums negative Renditen auswiesen.

» Ein Engagement bei globalen Immobilienfonds war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da diese während des Berichtszeitraums negative Renditen auswiesen.

» Ein Engagement bei Rohstoffen war der absoluten Wertentwicklung abträglich, da diese während des Berichtszeitraums negative Renditen auswiesen.

» Engagements bei Gold waren der absoluten Wertentwicklung abträglich, da Gold während des Berichtszeitraums negative Renditen auswies.

# Low Average Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 5. Dez. 2002) | 0,68 % | 3,04 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 5. Dez. 2002) | 0,76 % | 3,04 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2004) | 0,28 % | 2,85 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Juli 2003) | 0,29 % | 2,60 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2004) | 0,21 % | 2,65 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Sept. 2007) | (0,16 %) | 2,14 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (0,20 %) | 2,47 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 4. Nov. 2009) | 0,54 % | 1,95 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,40 % | 0,39 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 27. Jan. 2010) | 1,12 % | 2,41 % |
| BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index | 0,54 % | 2,25 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 23. Nov. 2015) | — | 0,30 % |
| BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (AUD Hedged) | — | 0,13 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Jan. 2012) | 0,29 % | 1,28 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 0,27 % | 3,08 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juli 2009) | (0,66 %) | 1,44 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (0,10 %) | 0,10 % |
| BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (EUR Hedged) | 0,04 % | 0,22 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. März 2010) | 0,93 % | 2,12 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,65 % | 0,65 % |
| BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (GBP Hedged) | 0,77 % | 1,08 %[2] |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010) | 0,09 % | 2,45 % |
| BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (ILS Hedged) | 0,35 % | 1,60 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Ein Engagement bei CMBS erhöhte die Rendite, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein positive Gesamtrenditen auswiesen.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration (oder die sensible Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) waren der Wertentwicklung abträglich, da hierdurch der Carry im Portfolio während des Berichtszeitraums vermindert wurde.

» Short-Engagements beim Euro waren der Wertentwicklung zuträglich, da der Euro gegenüber dem US-Dollar während des Berichtszeitraums an Wert verlor.

» Eine Untergewichtung von US-Duration belastete die Wertentwicklung, indem während des Berichtszeitraums Ertrag und Carry im Portfolio gegenüber der Benchmark vermindert wurden.

» Bestände bei griechischen regierungsnahen Schuldtiteln kamen der Wertentwicklung zugute, da die Zinsen in Griechenland zurückgingen.

» Engagements bei Non-Agency-RMBS waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Kurse für diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein anzogen.

# Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,69 % | 1,14 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,68 % | 1,13 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (0,30 %) | 0,22 % |
| Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged) | 1,16 % | 1,52 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (0,89 %) | 0,16 % |
| Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (CHF Hedged) | (0,35 %) | 0,54 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,20 % | 0,87 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,25 % | 0,87 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (0,70 %) | (0,05 %) |
| Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged) | 0,69 % | 1,22 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,88 % | 1,41 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,89 % | 1,38 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,58 % | 1,08 % |
| Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged) | 1,40 % | 1,78 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Der untergewichtete Metall- und Bergbausektor war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der übergewichtete Maklersektor war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der übergewichtete Mediensektor war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der übergewichtete Pipeline-Sektor war für die relative Wertentwicklung nachteilig, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.

# PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,54 %) | (28,85 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,55 %) | (28,86 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,87 %) | (29,13 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,76 %) | (29,04 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,44 %) | (29,70 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,47 %) | (29,73 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,47 %) | (29,73 %) |
| Alerian MLP Index | (32,59 %) | (36,41 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,87 %) | (29,13 %) |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (25,87 %) | (29,14 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,19 %) | (29,42 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,09 %) | (29,33 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,76 %) | (29,98 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,76 %) | (29,99 %) |
| Alerian MLP Index EUR (Hedged) | (32,22 %) | (36,08 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,08 %) | (29,32 %) |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,06 %) | (29,31 %) |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,19 %) | (29,42 %) |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Nov. 2014) | (26,25 %) | (29,47 %) |
| Alerian MLP Index GBP (Hedged) | (32,73 %) | (36,54 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Die vom Teilfonds angestrebte „Gesamtrendite" Besteht aus Ertrag und Kapitalzuwachs. Der Teilfonds ist bestrebt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er unter normalen Umständen zwei Drittel seines Nettovermögens entweder direkt oder indirekt in ein Portfolio aus Aktien anlegt, die verbunden sind mit (i) börsengehandelten Partnerships, die auch als Master Limited Partnerships („MLPs") bezeichnet werden, (ii) den General Partners, die Eigentümer oder Manager von MLPs sind, (iii) Spin-Offs (Unternehmen, die nach Beteiligungsverkäufen oder Umstrukturierungen von den MLPs oder General Partner ausgegliedert werden) von MLPs, (iv) Unternehmen, die aufgrund dessen, dass sie in derselben Industrie tätig sind oder mit MLPs konkurrieren, MLPs ähnlich sind, (v) andere juristische Person, die ggf. nicht als börsengehandelte Partnership strukturiert sind, jedoch im Midstream-Energiesektor tätig sind (die Transportkomponente des Energieinfrastruktursektors wie Pipelines, Bahn und Öl sowie Öltanker) und (vi) Zweckgesellschaften (d. h. juristische Personen, die für einen bestimmten Zweck errichtet wurden, die ggf. als Anlagevehikel verwendet werden, um Zugang zu im Verkaufsprospekt beschriebenen Anlagen zu erlangen). Der Teilfonds kann in diese Instrumente entweder auf dem Sekundärmarkt oder während einer Neuemission anlegen.

» Die Wertpapierauswahl im Teilsektor Vermarktung/Großhandel wirkte sich positiv auf die Rendite aus, da sich diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten.

» Eine Untergewichtung von Werten aus dem Bereich der Förderung und des Abbaus von Kohlenwasserstoff war der relativen Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der breiter gefasste MLP Index.

» Eine Übergewichtung des Verflüssigungssektors war der Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der breiter gefasste MLP Index.

» Operative Barbestände wirkten sich positiv auf die Rendite aus, da der breitere MLP-Sektor während des Berichtszeitraums abverkauft wurde.

» Eine Untergewichtung des Sektors für Erdgasbeförderung in Pipelines war der Rendite abträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der breiter gefasste MLP Index.

» Eine Untergewichtung des Sektors für Petroleumbeförderung in Pipelines war der Rendite abträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der breiter gefasste MLP Index.

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (23,30 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (23,60 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (23,70 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | — | (17,36 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (21,30 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (21,60 %) |
| Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (21,80 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged) | — | (15,23 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (18,10 %) |
| Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (18,20 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (GBP Unhedged) | — | (11,81 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Hierfür investiert er unter normalen Umständen in Wertpapiere, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Aus Ausgangspunkt für die Auswahl dieser Wertpapiere dient die Methode des RAFI® Fundamental Index® („RAFI"). Die von Research Affiliates, LLC (die „Unter-Anlageberatungsgesellschaft") entwickelte RAFI-Methode ist eine nicht auf die Kapitalisierung abzielende Methode für die Auswahl und Gewichtung von Aktientiteln innerhalb eines definierten Marktes, die darauf abzielt, die mit marktkapitalisierungsorientierten Aktienindizes einhergehende potenzielle Übergewichtung überbewerteter Aktien sowie die Untergewichtung unterbewerteter Aktien zu eliminieren.

» Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2015 auf.

» Die wertorientierte Ausrichtung des Teilfonds war der Wertentwicklung abträglich, da die Substanzaktien des MSCI Emerging Market während des sechsmonatigen Berichtszeitraums deutlich schlechter abschnitten als der MSCI Emerging Markets Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Metall- und Bergbaubranche war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche deutlich schwächer entwickelte als der MSCI Emerging Markets Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Bankenbranche war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche schwächer entwickelte als der MSCI Emerging Markets Index.

» Engagements in der Branche für langlebige Haushaltsgüter, insbesondere eine Übergewichtung von LG Electronics, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus, da die Branche besser abschnitt als der MSCI Emerging Markets Index.

# PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,80 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,20 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,30 %) |
| MSCI Europe Index | — | (4,01 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (3,00 %) |
| Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (3,10 %) |
| MSCI Europe Index (GBP Unhedged) | — | (0,15 %) |
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional USD (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (9,10 %) |
| Class E USD (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (9,50 %) |
| Class T USD (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (9,70 %) |
| MSCI Europe Index (USD Unhedged) | — | (6,42 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental Europe Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Europe Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Hierfür investiert er unter normalen Umständen in Wertpapiere, die wirtschaftlich mit europäischen Ländern verbunden sind. Aus Ausgangspunkt für die Auswahl dieser Wertpapiere dient die Methode des RAFI® Fundamental Index® („RAFI"). Die von Research Affiliates, LLC (die „Unter-Anlageberatungsgesellschaft") entwickelte RAFI-Methode ist eine nicht auf die Kapitalisierung abzielende Methode für die Auswahl und Gewichtung von Aktientiteln innerhalb eines definierten Marktes, die darauf abzielt, die mit marktkapitalisierungsorientierten Aktienindizes einhergehende potenzielle Übergewichtung überbewerteter Aktien sowie die Untergewichtung unterbewerteter Aktien zu eliminieren.

» Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2015 auf.

» Die wertorientierte Ausrichtung des Teilfonds war der Wertentwicklung abträglich, da die Substanzaktien des MSCI Europe während des sechsmonatigen Berichtszeitraums deutlich schlechter abschnitten als der MSCI Europe Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Energiebranche war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche deutlich schwächer entwickelte als der MSCI Europe Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Luftfahrtbranche war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich diese Branche besser entwickelte als der MSCI Europe Index.

# PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,00 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,40 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,60 %) |
| MSCI World Index | — | (3,41 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (4,60 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,00 %) |
| Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,20 %) |
| MSCI World Index (EUR Hedged) | — | (0,93 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (0,80 %) |
| Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (0,90 %) |
| MSCI World Index (GBP Unhedged) | — | 3,06 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Hierfür investiert er unter normalen Umständen in Wertpapiere, die wirtschaftlich mit Industrieländern weltweit verbunden sind. Aus Ausgangspunkt für die Auswahl dieser Wertpapiere dient die Methode des RAFI® Fundamental Index® („RAFI"). Die von Research Affiliates, LLC (die „Unter-Anlageberatungsgesellschaft") entwickelte RAFI-Methode ist eine nicht auf die Kapitalisierung abzielende Methode für die Auswahl und Gewichtung von Aktientiteln innerhalb eines definierten Marktes, die darauf abzielt, die mit marktkapitalisierungsorientierten Aktienindizes einhergehende potenzielle Übergewichtung überbewerteter Aktien sowie die Untergewichtung unterbewerteter Aktien zu eliminieren.

» Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2015 auf.

» Die wertorientierte Ausrichtung des Teilfonds war der Wertentwicklung abträglich, da die Substanzaktien des MSCI World während des sechsmonatigen Berichtszeitraums schlechter abschnitten als der MSCI World Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Branche für Erdöl, Erdgas und nicht erneuerbare Brennstoffe war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche deutlich schwächer entwickelte als der MSCI World Index.

» Das untergewichtete Engagement bei der Branche für Internetsoftware und -dienstleistungen war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche deutlich besser entwickelte als der MSCI World Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Branche für diversifizierte Telekommunikationsdienst-leistungen war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der MSCI World Index.

# PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (25,21 %) | (9,54 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (25,24 %) | (9,55 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | (14,92 %) | (4,52 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (16,75 %) | (1,78 %) |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (16,77 %) | (1,83 %) |
| Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | — | (2,20 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Sept. 2013) | (17,82 %) | (5,44 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged) | 5,23 % | 3,68 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (20,85 %) | (7,46 %) |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (20,92 %) | (7,49 %) |
| MSCI Emerging Markets Index (GBP Unhedged) | (9,99 %) | (2,35 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (zuvor: EM Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund) strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS" bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung als die eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI Emerging Markets Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental Emerging Markets Strategy (wie im Verkaufsprospekt näher erklärt) ausgewählt.

» In den zwölf Monaten zum 31. Dezember 2015 war das Engagement des Teilfonds bei der RAE Fundamental Emerging Markets Strategy der Rendite im Vergleich zum MSCI Emerging Markets Index abträglich. Dies war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:

» Auf Länderebene war ein allgemein übergewichtetes Engagement in Brasilien, Indien und Südafrika der Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

» Auf Sektor- und Branchenebene wurde die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums durch ein übergewichtetes Engagement bei Finanzwerten, insbesondere Banken, belastet.

» Auf Sektor- und Branchenebene hatte ein übergewichtetes Engagement bei rohstoffsensitiven Branchen wie Erdöl, Erdgas und nicht erneuerbare Brennstoffe sowie Metalle und Bergbau, die angesichts fallender Rohstoffpreise schwächer abschnitten als der breitere Markt, negative Auswirkungen auf die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums.

» Ein Short-Engagement bei US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da US-Schatztitel während des Berichtszeitraums allgemein positive Renditen verbuchten.

» Ein Engagement bei Zinssätzen in Brasilien wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da die Renditen in Brasilien während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Die Währungsstrategien lieferten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, was vor allem Short-Engagements beim Euro, beim japanischen Yen und beim chinesischen Yuan zu verdanken war, die während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

# PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (8,85 %) | 2,99 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (8,84 %) | 2,99 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (9,24 %) | (2,24 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (9,18 %) | (2,21 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,00 %) | (3,07 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (10,09 %) | (3,16 %) |
| MSCI World Index | (0,87 %) | 6,94 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 1,49 % | 11,83 % |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 1,48 % | 11,85 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Sept. 2013) | 0,25 % | 9,29 % |
| Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 1,51 % | 8,83 % |
| MSCI World Index (EUR Unhedged) | 10,42 % | 16,13 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2014) | (6,49 %) | (5,08 %) |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 30. Sep. 2014) | (6,54 %) | (3,96 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Sept. 2014) | (7,65 %) | (6,50 %) |
| MSCI World (EUR Hedged) Index | 1,74 % | 3,07 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (3,59 %) | 5,35 % |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (3,54 %) | 5,36 % |
| MSCI World Index (GBP Unhedged) | 4,87 % | 9,38 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (zuvor: Global Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund) strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung als die eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI World Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental Global Developed Strategy (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds näher erklärt) ausgewählt.

» Ein untergewichtetes Engagement bei der Branche für Internet- und Kataloghandel wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da diese Branche während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Gesamtmarkt.

» Eine Übergewichtung des Energiesektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, wirkte sich während des Berichtszeitraums negativ auf die Rendite aus.

» Ein untergewichtetes Engagement bei der Branche für Internetsoftware und Dienstleistungen wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da diese Branche während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt.

» Ein Short-Engagement bei US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da US-Schatztitel während des Berichtszeitraums allgemein positive Renditen verbuchten.

» Ein Engagement bei Zinssätzen in Brasilien wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung aus, da die Renditen in Brasilien während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Die Währungsstrategien lieferten einen positiven Beitrag zur Rendite, was vor allem Short-Engagements beim Euro, beim japanischen Yen und beim chinesischen Yuan zu verdanken war, die während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

# PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (4,95 %) | 8,54 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | (4,95 %) | 8,50 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (5,32 %) | 4,12 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (5,29 %) | 4,15 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (6,06 %) | 3,22 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (6,11 %) | 3,17 % |
| S&P 500 Index | 1,38 % | 12,25 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Mai 2014) | (4,96 %) | 2,09 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 7. Mai 2015) | — | (5,31 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 2. Sept. 2014) | (6,33 %) | (4,02 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (6,53 %) | (2,08 %) |
| S&P 500 (EUR Hedged) Index | 1,67 % | 7,39 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 5,84 % | 17,94 % |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 5,91 % | 17,83 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. März 2014) | 4,51 % | 15,93 % |
| Class G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | — | 7,40 % |
| S&P 500 (EUR Unhedged) Index | 12,73 % | 22,12 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 0,55 % | 10,97 % |
| Institutional GBP (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 3. Sept. 2013) | 0,62 % | 11,01 % |
| S&P 500 (GBP Unhedged) Index | 7,29 % | 14,83 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (zuvor: US Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund) ist bemüht, einen über seinem Vergleichsindex, dem S&P 500 Index, liegenden Gesamtertrag zu erzielen (wie im Verkaufsprospekt definiert). Der Teilfonds befolgt die gesetzlich geschützte Portfolioverwaltungsstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung eines Aktienindex, in diesem Fall des S&P 500, erreicht wird). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental US Strategy (wie im Verkaufsprospekt des Teilfonds näher erklärt) ausgewählt.

» Ein untergewichtetes Engagement bei der Branche für Internet- und Kataloghandel wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Ein untergewichtetes Engagement bei der Branche für Internetsoftware und -dienstleistungen wirkte sich negativ auf die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei rohstoffsensitiven Branchen wie Erdöl, Erdgas und nicht erneuerbare Brennstoffe sowie Metalle und Bergbau, die angesichts fallender Rohstoffpreise schwächer abschnitten als der breitere Markt, hatte negative Auswirkungen auf die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums.

» Ein Short-Engagement bei US-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da US-Schatztitel während des Berichtszeitraums allgemein positive Renditen verbuchten.

» Die Währungsstrategien lieferten einen positiven Beitrag zur Rendite, was vor allem Short-Engagements beim Euro, beim japanischen Yen und beim chinesischen Yuan zu verdanken war, die während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Beteiligungen an Non-Agency-Hypotheken verstärkten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums positive Renditen verbuchten.

# PIMCO RAE Fundamental US Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (3,60 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (4,10 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (4,20 %) |
| S&P 500 Index | — | 0,15 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (1,20 %) |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (1,60 %) |
| Class T EUR (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (1,80 %) |
| S&P 500 (EUR Unhedged) Index | — | 2,64 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | 2,80 % |
| Class R GBP (Unhedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | 2,70 % |
| S&P 500 (GBP Unhedged) Index | — | 6,96 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der PIMCO RAE Fundamental US Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem S&P 500 Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Hierfür investiert er unter normalen Umständen in Wertpapiere von US-amerikanischen Unternehmen. Aus Ausgangspunkt für die Auswahl dieser Wertpapiere dient die Methode des RAFI® Fundamental Index® („RAFI"), die auf ein breites Universum US-amerikanischer Unternehmen angewandt wird. Die von Research Affiliates, LLC (die „Unter-Anlageberatungsgesellschaft") entwickelte RAFI-Methode ist eine nicht auf die Kapitalisierung abzielende Methode für die Auswahl und Gewichtung von Aktientiteln innerhalb eines definierten Marktes, die darauf abzielt, die mit marktkapitalisierungsorientierten Aktienindizes einhergehende potenzielle Übergewichtung überbewerteter Aktien sowie die Untergewichtung unterbewerteter Aktien zu eliminieren.

» Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2015 auf.

» Die wertorientierte Ausrichtung des Teilfonds war der Wertentwicklung abträglich, da die Substanzaktien des S&P 500 während des sechsmonatigen Berichtszeitraums schlechter abschnitten als der S&P 500 Index.

» Das untergewichtete Engagement bei der Branche für Internet- und Kataloghandel war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche besser entwickelte als der S&P 500 Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Branche für Erdöl, Erdgas und nicht erneuerbare Brennstoffe war der relativen Wertentwicklung abträglich, da sich diese Branche schwächer entwickelte als der S&P 500 Index.

» Das übergewichtete Engagement bei der Versorgungsbranche war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der S&P 500 Index.

# Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. April 2010) | (3,51 %) | 3,80 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter | 0,77 % | 5,54 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2013) | (3,79 %) | (0,41 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Mai 2011) | (4,20 %) | 1,97 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (EUR Hedged) | 0,38 % | 3,36 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Feb. 2013) | (2,81 %) | (1,05 %) |
| Investor NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. März 2014) | (3,14 %) | 0,47 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (NOK Hedged) | 1,38 % | 2,22 %[2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Investor SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 6. Feb. 2014) | (5,38 %) | (0,74 %) |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (SEK Hedged) | 0,09 % | 4,02 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den maximal möglichen Gesamtertrag erzielen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein aktiv verwaltetes, diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die wirtschaftlich mit Schwellenmarktländern verbunden sind. Die Beteiligung an solchen Emittenten lässt sich über die direkte Anlage in Rentenpapiere (wie im Verkaufsprospekt definiert) oder über den Einsatz von derivativen Finanzinstrumenten (wie im Verkaufsprospekt näher definiert) erreichen. Alle Wertpapiere werden von den Anlageberatungsgesellschaften gemäß einem ethischen Auswahlverfahren ausgewählt, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

» Eine Übergewichtung russischer Anleihen, die während des Berichtszeitraums besser abschnitten als der Markt insgesamt, war der relativen Wertentwicklung zuträglich.

» Eine Übergewichtung kasachischer Anleihen, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, war der Wertentwicklung zuträglich.

» Eine Übergewichtung brasilianischer Anleihen, die sich gegenüber dem Index unterdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich negativ auf die relative Wertentwicklung während des Berichtszeitraums aus.

» Eine Untergewichtung argentinischer Anleihen, die während des Berichtszeitraums besser abschnitten als der Markt insgesamt, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

» Eine Untergewichtung ukrainischer Anleihen, die während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich abschnitten, war der relativen Wertentwicklung abträglich.

# StocksPLUS™ Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Dez. 1998) | 0,39 % | 5,04 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Nov. 2001) | 0,38 % | 6,44 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 7. Jan. 1999) | 0,00 % | 4,49 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2006) | (0,56 %) | 6,51 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | 0,93 % | 17,57 % |
| S&P 500 Index | 1,38 % | 4,99 % [2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2012) | 0,33 % | 14,04 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 0,34 % | 6,54 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (1,05 %) | 2,63 % |
| S&P 500 (EUR Hedged) Index | 1,67 % | 14,25 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Die Rentenwertstrategien des Portfolios waren der Rendite abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die unter folgenden drei Punkten aufgeführten Faktoren zurückzuführen:

» Das Engagement bei US-Duration (oder die sensible Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen von US Treasuries während des Berichtszeitraums stiegen.

» Die Währungsstrategien lieferten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, was vor allem Short-Engagements beim Euro, beim japanischen Yen und beim chinesischen Yuan zu verdanken war, die während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Beteiligungen an Non-Agency-Hypotheken verstärkten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums positive Renditen verbuchten.

# Strategic Income Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,48 %) | 3,04 % |
| Institutional, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,46 %) | 3,02 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,85 %) | 2,66 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,82 %) | 2,65 % |
| Administrative Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (3,03 %) | 2,50 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (3,33 %) | 2,13 % |
| Class E, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (3,40 %) | 2,08 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (1,76 %) | 3,82 % |
| 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index | 0,34 % | 3,81 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,17 %) | 3,89 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,16 %) | 3,87 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (3,02 %) | 2,94 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | (2,99 %) | 2,99 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Sept. 2015) | — | (0,90 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (3,47 %) | (2,08 %) |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (3,37 %) | (1,99 %) |
| 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged EUR / 25 % MSCI All Country World Index Net EUR | 0,83 % | 4,59 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Engagements bei Non-Agency-RMBS waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Kurse für diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein anzogen.

» Die Aktienauswahl im Energiesektor war für die Wertentwicklung während des Berichtszeitraums ungünstig.

» Short-Engagements beim Euro waren der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Eine Untergewichtung der Duration von Industriemärkten außerhalb der USA war der Wertentwicklung abträglich, da sich hierdurch der Carry im Portfolio während des Berichtszeitraums verminderte.

» Engagements bei lokaler brasilianischer Zinsduration waren für die Wertentwicklung nachteilig, da sich brasilianische Zinssätze während des Berichtszeitraums allgemein erhöhten.

# Total Return Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 1998) | 0,71 % | 5,72 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. April 2000) | 0,73 % | 5,88 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Jan. 1999) | 0,35 % | 5,15 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Okt. 2000) | 0,34 % | 5,24 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Mai 2003) | 0,20 % | 4,23 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,20 %) | 4,47 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 10. Okt. 2005) | (0,22 %) | 4,23 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002) | 0,53 % | 4,98 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,49 % | 0,68 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,40 % | 0,65 % |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | 0,68 % | 1,89 % |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (0,50 %) | (0,17 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2008) | 1,22 % | 5,82 % |
| Barclays US Aggregate Index | 0,55 % | 5,15 % [2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 2. Mai 2013) | 1,26 % | 1,18 % |
| Barclays US Aggregate Index (CAD Hedged) | 1,15 % | 1,99 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011) | (0,82 %) | 1,84 % |
| Investor CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011) | (1,11 %) | 1,49 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 19. Sept. 2012) | (1,70 %) | (0,46 %) |
| Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index | (1,04 %) | 2,07 % [2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2003) | 0,29 % | 4,63 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 0,29 % | 4,90 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2004) | (0,05 %) | 4,24 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013) | (0,06 %) | 0,46 % |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 14. Okt. 2009) | (0,25 %) | 3,12 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (0,62 %) | 4,20 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. März 2012) | (0,66 %) | 1,06 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 0,34 % | 1,32 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,00 % | 0,39 % |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | 0,29 % | 1,62 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2014) | (0,89 %) | 0,08 % |
| Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index | 0,19 % | 3,98 % [2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Juni 2002) | 12,20 % | 4,04 % |
| Barclays US Aggregate Index (EUR Unhedged) Index | 12,00 % | 3,55 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 26. März 2010) | 0,99 % | 3,65 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 0,94 % | 5,57 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juni 2011) | 0,63 % | 2,50 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 0,75 % | 0,86 % |
| Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index | 0,92 % | 3,91 % [2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (0,20 %) | 0,21 % |
| Class M Retail HKD (Unhedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 20. Feb. 2013) | (0,24 %) | 0,14 % |
| Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index | 0,49 % | 1,74 % |

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Untergewichtung erstklassiger Unternehmensanleihen war der relativen Performance zuträglich, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums erweiterten.

» Long-Positionen auf den US-Dollar gegenüber dem Euro und dem japanischen Yen trugen zur Wertentwicklung bei, da beide Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Ein Engagement bei der Spread-Duration von Staatsanleihen europäischer Peripherieländer, insbesondere Italien, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich die Spreads gegenüber deutschen Bundesanleihen während des Berichtszeitraums verengten.

» Eine Untergewichtung der US-Duration (oder sensible Reaktion auf Änderungen der Marktzinsen), die durch eine Short-Position auf Swap Spread Duration erreicht wurde, war der Wertentwicklung abträglich, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums verengten.

» Engagements in US Treasury Inflation-Protected Securities waren der Wertentwicklung abträglich, da die Break-Even-Inflationsraten während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Ein Short-Engagement am vorderen Ende der britischen Renditekurve belastete die Wertentwicklung, da sich hierdurch der Carry im Portfolio während des Berichtszeitraums verminderte.

# Total Return Bond Fund (Forts.)

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Mai 2010) | 0,49 % | 3,94 % |
| Barclays US Aggregate (ILS Hedged) Index | 0,38 % | 4,34 % |
| **Auf JPY lautende Klassen** | | |
| Institutional JPY (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Juli 2014) | 0,10 % | 0,62 % |
| Barclays US Aggregate (JPY Hedged) Index | (0,02 %) | 1,31 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Jan. 2011) | 1,48 % | 3,07 % |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2007) | 0,60 % | 3,95 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 1. Aug. 2012) | 0,64 % | 0,71 % |
| Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index | 1,69 % | 3,48 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,90 %) |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (am 30. Juni 2015 aufgelegt) | — | (5,89 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,00 %) |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,00 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,40 %) |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung. 30. Juni 2015) | — | (6,40 %) |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,90 %) |
| 3 Month USD LIBOR Index | — | 0,15 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,50 %) |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (7,10 %) |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | — | (0,61 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,20 %) |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,25 %) |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,40 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,70 %) |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,70 %) |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,20 %) |
| 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index | — | 1,00 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,75 %) |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (6,30 %) |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2015) | — | (5,79 %) |
| 3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index | — | 0,25 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 30. Juni 2015 auf.

» Short-Engagements beim kanadischen Dollar und beim australischen Dollar trugen zur Wertentwicklung bei, da beide Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Eine Long-Position auf japanische Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da japanische Zinsen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Positionen beim Euro gegenüber anderen Hauptwährungen wie dem britischen Pfund, der schwedischen Krone, dem US-Dollar und dem japanischen Yen waren der Wertentwicklung abträglich, da diese Währungspaare während des Berichtszeitraums keine bedeutenden Preistrends verzeichneten.

» Positionen bei der durch US-Aktien implizierten Volatilität belasteten die Wertentwicklung, da der VIX Index während des Berichtszeitraums starke Trendwenden verzeichnete.

» Positionen bei globalen Aktien, die während des Berichtszeitraums scharfe Kehrwenden vollzogen anstatt längeren Trends zu folgen, waren der Wertentwicklung abträglich.

# UK Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Sept. 2007) | 0,94 % | 6,75 % |
| BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 0,71 % | 6,23 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Übergewichtung des Bankensektors, der besser abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Untergewichtung des Gesundheitssektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Untergewichtung des Versorgungssektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums zuträglich.

» Eine Übergewichtung des Einzelhandelssektors, der schwächer abschnitt als der Gesamtmarkt, war der relativen Wertentwicklung während des Berichtszeitraums abträglich.

# UK Long Term Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2005) | 0,26 % | 6,29 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Aug. 2008) | 0,26 % | 9,29 % |
| BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index | (0,17 %) | 5,65 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Der übergewichtete Bankensektor war der Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der untergewichtete Metall- und Bergbausektor war der Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der untergewichtete Festnetzsektor war der Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.

» Der übergewichtete Energiesektor war für die Wertentwicklung nachteilig, da der Sektor während des Berichtszeitraums schlechter abschnitt als der Markt insgesamt.

# UK Low Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 1. Sept. 2006) | 0,29 % | 3,72 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 13. Sept. 2011) | 0,26 % | 1,64 % |
| Barclays Sterling Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index | 1,29 % | 3,79 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der UK Low Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds beabsichtigt, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von auf GBP lautenden Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt.

» Engagements in europäischen Peripherieländern wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, was vor allem positivem Carry während des Berichtszeitraums zu verdanken war.

» Engagements bei ausgewählten hoch verzinslichen Unternehmensanleihen, insbesondere innerhalb des Bankensektors, wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sie während des Berichtszeitraums positive Erträge lieferten.

» Eine Übergewichtung der britischen Duration (oder die sensible Reaktion auf Änderungen der Marktzinsen) mit mittelfristiger Laufzeit war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Short-Engagement bei der US-amerikanischen Duration belastete die Wertentwicklung, da sinkende Renditen im dritten Quartal einen positiven Beitrag während eines Großteils des Berichtszeitraums mehr als ausglichen.

» Engagements bei Schuldtiteln in Landeswährung ausgewählter Schwellenmarktländer in Lateinamerika und Zentraleuropa waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen während des Berichtszeitraums anstiegen.

# UK Real Return Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Aug. 2003) | (2,46 %) | 6,65 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 6. April 2004) | (2,49 %) | 6,57 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Okt. 2005) | (3,41 %) | 5,34 % |
| FTSE Actuaries Government Securities UK Index Linked Gilts > 5 Years | (1,21 %) | 7,45 %[2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der UK Real Return Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens 80 % seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus inflationsgekoppelten Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) unterschiedlicher Laufzeiten anlegt, welche von Regierungen, ihren Vertretungen oder Behörden und Unternehmen ausgegeben wurden.

» Eine Übergewichtung 50-jähriger britischer inflationsgebundener Anleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei, da diese Sätze während des Berichtszeitraums deutlich stiegen.

» Ein Engagement bei US Treasury Inflation-Protected Securities war der Wertentwicklung abträglich, da die Effektivrenditen während des Berichtszeitraums nach oben gingen.

» Ein Engagement bei deutschen Nominalzinsen (Short-Position während des ersten Quartal 2015, als die Zinsen anstiegen, gefolgt von einer Long-Position im zweiten Quartal 2015, als die Zinsen sanken, gefolgt von einer Short-Position für den Rest des Jahres, in dem die Zinsen wieder stiegen) war der Wertentwicklung im Saldo abträglich.

» Engagements bei brasilianischen Nominalsätzen in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen in Brasilien stiegen.

# UK Sterling Long Average Duration Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Sept. 2004) | (1,21 %) | 6,94 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 21. Nov. 2005) | (1,17 %) | 6,40 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 29. Aug. 2008) | (1,33 %) | 8,22 % |
| FTSE Actuaries Government Securities UK Gilts All Stocks > 15 Years | 0,09 % | 7,03 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

» Der UK Sterling Long Average Duration Fund möchte bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung den höchst möglichen Gesamtertrag erzielen. Der Teilfonds legt mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio von internationalen Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) an.

» Beteiligungen an UK Gilts mit langen Laufzeiten kamen der absoluten Wertentwicklung zugute, da die Wertentwicklung dieser Anlageklasse während des Berichtszeitraums knapp positiv ausfiel.

» Die Positionierung entlang der Zinsstrukturkurve für britische Gilts war der relativen Wertentwicklung abträglich, da diese Kurve während des Berichtszeitraums steiler wurde.

» Beteiligungen an Staatsanleihen europäischer Peripherieländer, insbesondere von Spanien und Italien, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Sätze für diese Länder während des Berichtszeitraums allgemein zurückgingen.

» Engagements beim US-Dollar wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem britischen Pfund an Wert zulegte.

» Engagements bei Schwellenmarktzinsen, insbesondere in Brasilien und Polen, waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen in diesen Ländern während des Berichtszeitraums anstiegen.

» Ein Short-Engagement beim japanischen Yen war der Wertentwicklung abträglich, da diese Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem britischen Pfund an Wert gewann.

# Unconstrained Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Dez. 2008) | (2,22 %) | 2,48 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Feb. 2010) | (2,23 %) | 1,71 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010) | (2,55 %) | 0,56 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 24. Sept. 2010) | (2,58 %) | 0,54 % |
| Administrative Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2010) | (2,78 %) | 1,17 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. Mai 2010) | (3,11 %) | 0,49 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Mai 2010) | (3,13 %) | 0,50 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,30 %) | (0,78 %) |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,39 %) | (0,81 %) |
| Class S, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | (2,27 %) | (0,50 %) |
| Class T, thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2014) | (3,41 %) | (2,99 %) |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Mai 2010) | (1,42 %) | 2,37 % |
| 1 Month USD LIBOR Index | 0,19 % | 0,24 % [2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 18. März 2014) | 0,68 % | 2,61 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 2,33 % | 2,50 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 8. Sept. 2010) | (3,41 %) | 0,39 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. April 2011) | (4,33 %) | (0,62 %) |
| Class S CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Okt. 2013) | (3,47 %) | (1,23 %) |
| 1 Month CHF LIBOR Index | (0,76 %) | (0,11 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Mai 2009) | (2,63 %) | 2,61 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Dez. 2009) | (2,60 %) | 1,82 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. Jan. 2011) | (2,91 %) | 0,66 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 15. Feb. 2013) | (2,88 %) | (1,50 %) |
| Administrative EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 21. Jan. 2010) | (3,11 %) | 1,16 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 20. Nov. 2009) | (3,44 %) | 0,89 % |
| Class G Institutional EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 28. Feb. 2014) | (2,51 %) | (0,78 %) |
| Class G Retail EUR (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Dez. 2010) | (3,42 %) | 0,24 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,61 %) | (0,98 %) |
| Class S EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 16. Okt. 2013) | (2,57 %) | (0,64 %) |
| 1 Month Euribor Index | (0,06 %) | 0,40 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Dez. 2009) | (1,99 %) | 2,04 % |
| Institutional GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 27. Feb. 2012) | (1,92 %) | 1,25 % |
| Investor GBP (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 26. Juli 2011) | (2,36 %) | 1,00 % |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. März 2010) | (2,86 %) | 0,90 % |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,09 %) | (0,55 %) |
| 1 Month GBP-LIBOR-Index | 0,51 % | 0,55 % [2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 11. April 2011) | (1,33 %) | 2,23 % |
| 1 Month NIBOR Index | 1,27 % | 1,82 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2013) | (2,80 %) | (0,88 %) |
| Administrative SEK (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Nov. 2011) | (3,29 %) | 1,28 % |
| 1 Month SEK LIBOR Index | (0,20 %) | 0,90 % [2] |

## Kommentare zum Portfolio

» Der Unconstrained Bond Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche langfristige Rendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Der Teilfonds wird nicht durch indexgekoppelte Anlagebeschränkungen des Rentenmarkts oder Ziele für den Tracking Error beschränkt. Die durchschnittliche Portfolioduration dieses Teilfonds bewegt sich normalerweise zwischen -3 bis +8 Jahren, je nach der Prognose der Anlageverwaltungsgesellschaften für den Zinssatz. Der Teilfonds verfolgt eine auf absoluten Ertrag ausgerichtete Strategie auf der Basis von Investment Grade- und Hochzins-Anleihen, die an keine vergleichsindexspezifischen Richtlinien oder wesentlichen Sektorbeschränkungen gebunden ist. Der Teilfonds verwendet die globalen Langzeitprognosen der Anlageberatungsgesellschaften sowie ein integriertes Anlageverfahren innerhalb vieler Sektoren mit einer Duration, die von -3 bis +8 Jahren reichen kann.

» Engagements bei Non-Agency-MBS waren der Wertentwicklung zuträglich, da verbriefte Instrumente während des Berichtszeitraums eine positive Wertentwicklung verbuchten.

» Short-Engagements gegenüber dem Euro, dem chinesischen Yuan und in der zweiten Jahreshälfte auch gegenüber dem brasilianischen Real wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da diese Währungen während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.

» Ein Long-Engagement bei Unternehmensanleihen, insbesondere bei US-Finanzwerten, war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Instrumente während des Berichtszeitraums insgesamt eine positive Wertentwicklung an den Tag legten.

» Ein Engagement bei brasilianischen nominellen Zinssätzen war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen während des Berichtszeitraums sanken.

» Positionen bei US Treasury Inflation-Protected Securities waren der Wertentwicklung abträglich, da die Break-Even-Inflationsraten während des Berichtszeitraums zurückgingen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 22. Mai 2013) | (2,27 %) | (1,86 %) |
| 1 Month SGD LIBOR Index | 0,78 % | 0,51 % |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

# US High Yield Bond Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 28. Mai 1998) | (2,15 %) | 5,78 % |
| Institutional Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 23. Jan. 2001) | (2,16 %) | 6,30 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. März 1999) | (2,46 %) | 5,44 % |
| Investor Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 14. Jan. 1999) | (2,51 %) | 5,40 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (3,03 %) | 4,52 % |
| Class E, ausschüttende Anteile (Auflegung: 31. Juli 2006) | (3,07 %) | 4,67 % |
| Class H Institutional, thesaurierende Anteile (Auflegung: 15. Okt. 2002) | (2,30 %) | 7,60 % |
| Class M Retail, ausschüttende Anteile (Auflegung: 11. Jan. 2012) | (3,13 %) | 4,15 % |
| Class R, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,35 %) | 2,59 % |
| Class R, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,43 %) | 2,61 % |
| BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index | (4,49 %) | 5,78 % [2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 9. Dez. 2011) | (1,84 %) | 6,25 % |
| BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (CAD Hedged) | (4,41 %) | 5,52 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 10. April 2003) | (2,56 %) | 6,15 % |
| Institutional EUR (Hedged) Class, ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Dez. 2005) | (2,59 %) | 5,16 % |
| Investor EUR (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 12. Feb. 2003) | (2,89 %) | 6,23 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 31. März 2006) | (3,44 %) | 4,16 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,72 %) | 2,28 % |
| BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged) | (4,96 %) | 6,46 % [2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Sept. 2003) | (2,17 %) | 6,63 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 30. Nov. 2012) | (2,35 %) | 2,75 % |
| BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged) | (4,57 %) | 6,97 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Eine Untergewichtung des Energiesektors war der relativen Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums hinter dem High-Yield-Anleihemarkt insgesamt zurückblieb.

» Eine Untergewichtung des Metall- und Bergbausektors war der relativen Rendite zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums hinter dem High-Yield-Anleihemarkt insgesamt zurückblieb.

» Eine Übergewichtung des Gesundheitssektors war der relativen Wertentwicklung zuträglich, da der Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der High-Yield-Anleihemarkt insgesamt.

» Der untergewichtete Festnetzsektor schmälerte die relative Rendite, da dieser Teilsektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

» Der untergewichtete Finanz- und Versicherungssektor schmälerte die relative Rendite, da dieser Sektor während des Berichtszeitraums besser abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

» Engagements bei mit CCC-bewerteten Titeln waren der Rendite abträglich, da dieser Qualitätsbereich schlechter abschnitt als der Markt für Hochzins-Anleihen insgesamt.

# US Short-Term Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014) | 1,30 % | 0,86 % |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014) | 0,90 % | 0,46 % |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Juni 2014) | 0,90 % | 0,46 % |
| Class Z, ausschüttende Anteile (Auflegung: 7. Aug. 2014) | 1,82 % | 1,29 % |
| Citi 3-Month US Treasury Bill Index | 0,03 % | 0,03 % [2] |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Kommentare zum Portfolio

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

» Das Engagement bei der kurzfristigen Duration europäischer Kernländer (oder der sensiblen Reaktion auf Änderungen der Marktzinsen) wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da europäische Swap-Sätze mit kurzer Laufzeit während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Eine Untergewichtung der dreijährigen US-Duration war der Wertentwicklung zuträglich, da die dreijährigen Renditen während des Berichtszeitraums zurückgingen.

» Short-Engagements beim Euro waren der Wertentwicklung zuträglich, da der Euro während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verlor.

» Engagements bei auf US-Dollar lautenden Anleihen aus Schwellenländern verstärkten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein positive Gesamtrenditen verbuchten.

» Engagements bei erstklassigen Schuldtiteln mit kürzerer Laufzeit verstärkten die Wertentwicklung, da diese erstklassigen Wertpapiere während des Berichtszeitraums allgemein positive Gesamtrenditen verbuchten.

» Short-Engagements bei britischen Zinspapieren wirkten sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze während des Berichtszeitraums anstiegen.

# US Small Cap StocksPLUS™ Fund

## Gesamtrendite, ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 1 Jahr | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2015) | — | (7,50 %) |
| Investor Class, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2015) | — | (7,80 %) |
| Class E, thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Feb. 2015) | — | (8,20 %) |
| Russell 2000® Index | — | (6,89 %) |

[1] *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*

## Kommentare zum Portfolio

- Der US Small Cap StocksPLUS™ strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem Russell 2000® Index, liegende Gesamtrendite an. Zur Erreichung des Anlageziels befolgt der Teilfonds die gesetzlich geschützte Portfolioverwaltungsstrategie der Anlageberatungsgesellschaften, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (und die ein Engagement bei einem Aktienindex, in diesem Fall beim Russell 2000® Index, mit einem aktiv verwalteten Rentenwertportfolio kombiniert). Gemäß der „StocksPLUS“ Portfolioverwaltungsstrategie und wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben, investiert der Fonds unter normalen Umständen in Derivate (vornehmlich Futures), die ein Engagement beim Russell 2000® Index bieten und die von einem Rentenwertportfolio (wie im Verkaufsprospekt definiert) besichert sind.
- Der Teilfonds nahm seine Geschäftstätigkeit am 25. Februar 2015 auf.
- Die Rentenwertstrategien des Portfolios waren der Rendite abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die unter folgenden drei Punkten aufgeführten Faktoren zurückzuführen:
  - Das Engagement bei US-Duration (oder die sensible Reaktion auf Änderungen bei den Marktzinsen) war der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen von US Treasuries während des Berichtszeitraums stiegen.
  - Die Währungsstrategien lieferten einen positiven Beitrag zur Wertentwicklung, was vor allem Short-Engagements beim Euro, beim japanischen Yen und beim chinesischen Yuan zu verdanken war, die während des Berichtszeitraums gegenüber dem US-Dollar an Wert verloren.
  - Beteiligungen an Non-Agency-Hypotheken verstärkten die Wertentwicklung, da diese Wertpapiere während des Berichtszeitraums positive Renditen verbuchten.

# Beschreibungen der Vergleichsindizes

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **[90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR]** | 90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI). Der JPMorgan Asia Credit Index (JACI) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet einen Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in fest und variabel verzinsten auf US-Dollar lautenden Anleihen von asiatischen Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen zuzüglich 10 % 1 Month USD-LIBOR. Der Vergleichsindex wird dann gegenüber dem JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+) abgesichert, der den Gesamtertrag von auf lokalen Währungen lautenden Geldmarktinstrumenten an Schwellenmärkten nachbildet, geteilt durch den 3 Month USD-LIBOR. |
| **1 Month CHF LIBOR Index** | Der 1 Month CHF LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month USD LIBOR Index** | Der 1 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month Euribor Index** | Der Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist der Vergleichszinssatz des ausgedehnten Euro-Geldmarkts. Dieser Index wird von der European Banking Federation, die 2.800 Banken in den fünfzehn Mitgliedsstaaten der Europäischen Union repräsentiert, und von der EWU-Abteilung der ACI, einer global agierenden Finanzmarktvereinigung, betrieben. Eine repräsentative Auswahl der wichtigsten Banken liefert tägliche Kurse für dreizehn Fälligkeiten von einer Woche bis zu einem Jahr, zu denen auf Euro lautende Interbank-Festgelder in der Eurozone zwischen den wichtigsten Banken gehandelt werden. Der durchschnittliche Zinssatz errechnet sich nach Löschen der höchsten/niedrigsten Kurse (15 % auf beiden Seiten). Der Euribor wird zu Kassavalutierung (T+2) und zu tatsächlichen/360-Tagessatzbedingungen angeboten und seit dem 4. Januar 1999 auf drei Kommastellen genau angegeben. Er wird 11:00 Uhr vormittags Brüsseler Zeit verbreitet. |
| **1 Month GBP-LIBOR-Index** | Der 1 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month NIBOR Index** | Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month SEK LIBOR Index** | Der 1 Month SEK LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **1 Month SGD LIBOR Index** | Der 1 Month SGD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, USD Hedged; BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged** | Der Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (USD Hedged) bietet ein weites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Rentenmärkte von Industrieländern. Der BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (USD Hedged) bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben und, basierend auf dem Durchschnitt aus Moody's, S&P und Fitch, mit BB1 bis B3 bewertet sind. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Der Indexausgleich findet am letzten Kalendertag eines Monats statt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **3 Month Euribor** | Der 3 Month Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist ein täglicher Referenzzinssatz auf der Basis der Zinssätze, zu denen sich Banken untereinander im Großhandel (auf dem sog. „Interbankenmarkt") unbesicherte Darlehen anbieten. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **3 Month GBP-LIBOR-Index** | 3 Month GBP LIBOR Index. Der LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **3 Month SGD LIBOR Index** | 3 Month SGD LIBOR Index. Der LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **3 Month STIBOR Index** | STIBOR (Stockholm Interbank Offered Rate) ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die am schwedischen Geldmarkt aktiv sind, bereit sind, sich untereinander unbesichert zu verschiedenen Laufzeiten Geld zu leihen. |
| **3 Month USD LIBOR (in CHF besichert)** | 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert). Der LIBOR (London Interbank Offered Rate) ist ein durchschnittlicher Zinssatz, den die ICE Benchmark Administration bestimmt und den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **3 Month USD LIBOR Index** | Der 3 Month USD-LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **45 % Global Advantage ILB Index (USD Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index** | 45 % Global Advantage ILB Index (USD Partial Hdg), 30 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed REITS Only Index (USD), 15 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % Bloomberg Gold Total Return Index. |
| **60 % MSCI All Country World Index/40 % Barclays Global Aggregate USD Hedged** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index/40 % Barclays Global Aggregate USD Hedged. Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 46 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. Der Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index** | Der Vergleichsindex ist der 75 % Barclays Capital Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index. Der MSCI ACWI ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI ACWI besteht aus 46 Länderindizes, die Indizes von 23 Industrie- und 23 Schwellenmarktländern umfassen. Der Barclays Global Aggregate Index Hedged USD bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **75 % MSCI All Country World Index Net USD/25 % Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index** | Der Vergleichsindex ist der 75 % MSCI All Country World Index Net USD/25 % Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index. Der MSCI ACWI ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI ACWI besteht aus 46 Länderindizes, die Indizes von 23 Industrie- und 23 Schwellenmarktländern umfassen. Der Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Alerian MLP Index** | Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst. |
| **Barclays 20 Yr, 25 Yr, 30 Yr and 35 Yr Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index** | Ein Mix des Barclays 20 Year, 25 Year, 30 Year and 35 Year Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index mit einer Gewichtung von 50 %, 30 %, 15 % bzw. 5 %. Hierbei handelt es sich um unverwaltete Indizes mit Nullkuponanleihen, deren Kurs abseits der Swap-Kurve bestimmt wird. Das nachbildende Portfolio besteht aus Baranlagen zum LIBOR kombiniert mit Nullkupon-Swaps, in dem regelmäßige LIBOR-Zahlungen gegen einen einzigen, festen Zahlungsfluss bei Fälligkeit getauscht werden. Zum Auflagezeitpunkt wird der Umfang der Baranlage gewählt, um den variablen Teil des Nullkupon-Swap auszugleichen, und er entspricht dem aktuellen Wert der festen Zahlung zum Nullkupon-Swap-Zinssatz mit der entsprechenden Fälligkeit. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index** | Der Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Barclays Pan-European Aggregate Index. Der Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index** | Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index ist die 1 - 3-jährige Komponente des Barclays Euro-Aggregate Index ex Treasuries. Der Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

# Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Barclays Euro-Aggregate Credit Index** | Der Barclays Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponente des Barclays Euro-Aggregate Index. Der Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index** | Der Barclays Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) +15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Barclays Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. |
| **Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond Index** | Der Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond Index wurde als Vergleichsindex für die wachsenden Märkte für inflationsgekoppelte Anleihen in der Eurozone geschaffen. Im Euro Inflation-Linked Bond Index sind derzeit Staatsanleihen aus Deutschland und Frankreich enthalten. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index** | Der Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index** | Der Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)** | Bei dem Barclays Global Aggregate Credit Index 1-5 Years Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade mit einer Laufzeit von mindestens einem 1 Jahr und weniger als 5 Jahren bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. |
| **Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)** | Bei dem Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Hedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged)** | Bei dem Barclays Global Aggregate Credit-Index (USD Unhedged) handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der ein weites Vergleichsspektrum für die internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade bietet. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Dieser Index schließt Staatstitel und verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays Sterling Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index** | Barclay's Sterling Aggregate ex Treasury 1-3 year Index bildet die Wertentwicklung der Sterling Aggregate-Komponente des Pan-European Aggregate Index mit einer Restlaufzeit von weniger als drei Jahren ab, wobei staatliche Werte ausgeschlossen sind. Der Pan-European Aggregate Index bildet geeignete erstklassige Wertpapiere Europas ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays US Aggregate Index** | Der Barclays US Aggregate Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind sowie auf Dollar lauten. Der Index deckt den erstklassigen US-Festzinsanleihemarkt ab und beinhaltet Indexkomponenten für Staatstitel sowie Industrieschuldverschreibungen, Hypotheken-Durchlauf-Wertpapiere sowie forderungsbesicherte Wertpapiere. Diese Hauptsektoren unterteilen sich in spezifischere Indizes, die regelmäßig berechnet und veröffentlicht werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index** | Bei dem Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged-Index handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen misst. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, Großbritannien und die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)** | Bei dem Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) handelt es sich um einen Index, der die Wertentwicklung der weltweiten Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen mit einer Laufzeit von mindestens 1 Jahr und weniger als 5 Jahren misst. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren: jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit Component USD Hdgd, BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained USD Hdgd, JPMorgan EMBI Global** | Der Index stellt eine gleichgewichtete Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren dar: Barclays Global Aggregate — Credit Component Hedged USD, BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained Index, JPMorgan EMBI Global. Der Barclays Global Aggregate Credit Index bietet ein breites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Festzinsmärkte. Der BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained Index bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Ländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index enthält auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautende Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. Der Indexausgleich findet am letzten Kalendertag eines Monats statt. Der JPMorgan EMBI Global bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Dieser Index bildet lediglich eine bestimmte Region oder ein bestimmtes Land ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Bloomberg AusBond Bank Bills Index** | Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **Bloomberg Commodity Index Total Return** | Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf 20 physische Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index** | Bei dem BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der US Treasuries (ausgenommen inflationsbesicherte Wertpapiere und STRIPS) mit mindestens 1 Milliarde USD umlaufendem Nennwert und einer Restlaufzeit bis zur endgültigen Fälligkeit von mindestens einem und weniger als drei Jahren enthält. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD** | Der BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten verfügen (basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch). Der Index enthält auf US-Dollar, kanadische Dollar, Pfund Sterling und Euro (oder eine Euro-Vorgänger-Währung) lautende Anleihen, schließt jedoch alle auf mehrere Währungen lautende Anleihen aus. Die Anleihen müssen über eine Bewertung unter Investment Grade, jedoch mindestens über eine Einstufung von B3 basierend auf einer Kombination aus Moody's, S&P sowie Fitch verfügen. Qualifizierte Anleihen müssen kapitalisierungsgewichtet sein, wobei die Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2 %-Deckelung entsprechend proportional. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. Vor dem 25. September 2009 waren die BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. |
| **BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index** | Der BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Pfund Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index** | Der BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb von Großbritannien ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index** | Der BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen. |
| **Citi 3-Month US Treasury Bill Index** | Bei dem Citi 3-Month US Treasury Bill Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der die monatliche Ertrags-Äquivalente der Renditedurchschnitte der Schatzwechselemissionen der vergangenen drei Monate repräsentiert. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **Citi Euro Broad Investment-Grade Index** | Bei dem Citi Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index von auf Euro basierenden Rentenmärkten der Kategorie Investment Grade, die institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich sind. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

# Beschreibungen der Vergleichsindizes (Forts.)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Citi World Government Bond Ex-US Index (USD Hedged)** | Der Citi World Government Bond Ex-U.S. Index (USD Hedged) beinhaltet die Staatsanleihemärkte der folgenden 18 Länder: Australien, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Griechenland, Irland, Italien, Japan, die Niederlande, Portugal, Spanien, Schweden, die Schweiz, Großbritannien, jedoch nicht die USA. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **FTSE Actuaries Government Securities UK Gilts All Stocks > 15 Years** | Der FTSE Actuaries Government Securities UK Gilts All Stocks > 15 Years ist ein nicht gemanagter Index für festverzinsliche britische Staatsanleihen und schließt alle britischen, auf Pfund Sterling lautende Staatspapiere ein, die an der Londoner Börse notiert werden, mit Ausnahme von indexgebundenen Aktien. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **FTSE Actuaries Government Securities UK Index Linked Gilts > 5 Years** | Der FTSE Actuaries Government Securities UK Index Linked Gilts > 5 Years ist ein nicht gemanagter Index für britische Staatspapiere und schließt sowohl UK-Gilts als auch indexgebundene Aktien einer Reihe von Sektoren ein. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)** | Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)** | Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global** | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter** | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter, bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbriefte Forderungen, Darlehen, Euroanleihen und lokale Marktinstrumente; ausgeschlossen sind Emittenten, die der SRI-Berater nicht zulässt. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)** | Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **MSCI All Country World Index** | Der MSCI All Country World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrie- und Schwellenländern zu messen. Der Index besteht aus 46 Länderindizes, von denen 23 Indizes von Industrieländern und 23 Indizes von Schwellenländern sind. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD)** | Der MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) ist ein um Streubesitz bereinigter Marktkapitalisierungsindex, der dazu gedacht ist, die Aktienmarktwertentwicklung von Schwellenmärkten zu messen. In einen Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **MSCI Europe Index** | Der MSCI Europe Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte der europäischen Industrieländer zu messen. Seit Juni 2007 besteht der MSCI Europe Index aus 16 Industrieländerindizes. Der Index bildet die nicht abgesicherte Wertentwicklung der in ihm enthaltenen Aktien in Euro ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **MSCI World Index** | Der MSCI World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI World Index besteht aus 23 Industrieländerindizes. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)** | Die OECD CPI +3 % (3 Month Lag) Benchmark entsteht, indem der jährlichen prozentualen Änderung des Consumer Price Index („CPI“) für 34 OECD-Mitgliedsländer 3 % hinzugerechnet werden. Der OECD Consumer Price Index ist ein unverwalteter Index, der eine Gesamtinflationsrate von Verbraucherpreisen von 34 Ländern verkörpert, wie von der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung festgelegt. Es ist keine Garantie dafür vorhanden, dass der OECD CPI oder andere Indizes die genaue Inflationsrate wiedergeben. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)** | Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged)** | PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged). Der PIMCO GLADI ILB repräsentiert den internationalen Rentenmarkt für inflationsgekoppelte Staatsanleihen, sowohl für Industrie- als auch Schwellenländer. Der Index berücksichtigt die Prinzipien der PIMCO Global Advantage Indizes, sofern diese auf den internationalen Markt für inflationsgekoppelte Anleihen anwendbar sind. |
| **Russell 2000® Index** | Der Russell 2000® Index setzt sich aus den 2,000 kleinsten Unternehmen im Russell 3000 Index zusammen und gilt als repräsentativ für den Small Cap-Markt insgesamt. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **S&P 500 Index** | Der S&P 500 Index ist ein nicht gemanagter Marktindex, der allgemein als repräsentativ für den Aktienmarkt insgesamt gilt. Der Index konzentriert sich auf das Large Cap-Segment des US-Aktienmarkts. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |

# Finanzstatus

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia Local Bond Fund[1] | | PIMCO Capital Securities Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 5.081 | $ 6.040.814 | $ 4.513.750 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 12.100 |
| Finanzderivate | 0 | 65 | 45.805 | 89.993 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1 | 255 | 16.204 | 5.351 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 0 | 16 | 51.798 | 42.606 |
| Forderungen aus Einkünften | 0 | 42 | 71.051 | 63.978 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 0 | 0 | 2.523 | 3.761 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 0 | 47.885 | 2.629 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 3 | 511 | 7.703 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 4 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 84.593 | 23.347 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 1 | 5.466 | 6.361.184 | 4.765.218 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | 0 | (43) | (69.059) | (34.058) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | 0 | (195) | (86) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | 0 | (13.550) | (11.907) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1) | 0 | (5.206) | (2.223) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | 0 | (8) | (5.436) | (4.069) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | (57.697) | (76.518) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | (2) | (290) | (117) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | (560) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | 0 | (54.964) | (38.467) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | (34.223) | (95.258) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (1) | (53) | (241.180) | (262.703) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 0 | $ 5.413 | $ 6.120.004 | $ 4.502.515 |

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

(1) Der PIMCO Asia Local Bond Fund wurde am 15. September 2015 geschlossen.

(2) Der Commodity Real Return Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von CommoditiesPLUS™ Strategy Fund.

| Commodity Real Return Fund[2] | | PIMCO Credit Absolute Return Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 496.970 | $ 380.500 | $ 988.605 | $ 1.667.494 | $ 5.833.719 | $ 8.128.952 | $ 1.071.294 | $ 1.808.108 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 10.588 | 5.683 | 15.839 | 23.739 | 38.670 | 218.453 | 7.964 | 55.740 |
| 1.727 | 1.367 | 7.312 | 8.888 | 20.816 | 24.237 | 3.639 | 10.528 |
| 2.425 | 11.939 | 15.590 | 39.824 | 114.528 | 114.457 | 10.305 | 5.276 |
| 2.066 | 1.697 | 7.057 | 13.306 | 85.254 | 132.407 | 16.291 | 29.547 |
| 483 | 131 | 12.089 | 19.810 | 27.341 | 173.256 | 10.843 | 3.206 |
| 9.455 | 120.294 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 807 | 451 | 56 | 248 | 1.886 | 3.206 | 29 | 420 |
| 0 | 1.532 | 2.082 | 9.582 | 5.057 | 0 | 3.693 | 13.005 |
| 0 | 1 | 0 | 9 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| 2.170 | 691 | 28.837 | 15.243 | 92.435 | 58.815 | 14.286 | 11.087 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 214 | 0 | 0 |
| 526.691 | 524.286 | 1.077.467 | 1.798.143 | 6.219.706 | 8.853.997 | 1.138.344 | 1.936.918 |
| (5.028) | (19.700) | (24.983) | (35.636) | (161.360) | (127.329) | (31.127) | (50.422) |
| (3.918) | (49.673) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (35) | (64) | (73) | (31) | (126) | (288) | (14) | (66) |
| (3.593) | (164) | (9.817) | (9.096) | (21.028) | (28.881) | (1.765) | (4.854) |
| (11.520) | (94.260) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (452) | (145) | (740) | (1.573) | (8.718) | (8.651) | (440) | (635) |
| (285) | (280) | (1.184) | (1.830) | (5.219) | (958) | (819) | (1.599) |
| (61.520) | (33.740) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (81.855) | (23.028) | 0 | (5.229) | (180.760) | (929.435) | (21.741) | (135.079) |
| (1) | 0 | (7) | (9) | (45) | (116) | (118) | (3) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (238) | 0 | 0 | 0 | 0 | (21.540) | 0 | 0 |
| (7.160) | (2.355) | (32.760) | (5.620) | (56.220) | (77.182) | (7.100) | (24.780) |
| (726) | (2.469) | (8.547) | (56.997) | (76.076) | (176.136) | (18.674) | (47.014) |
| 0 | 0 | (22) | 0 | (210) | (308) | (1) | 0 |
| (176.331) | (225.878) | (78.133) | (116.021) | (509.762) | (1.370.824) | (81.799) | (264.452) |
| $ 350.360 | $ 298.408 | $ 999.334 | $ 1.682.122 | $ 5.709.944 | $ 7.483.173 | $ 1.056.545 | $ 1.672.466 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Dividend and Income Builder Fund | | Emerging Asia Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 109.721 | $ 136.487 | $ 53.636 | $ 86.551 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 302 | 354 | 670 | 1.551 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 752 | 270 | 616 | 7.162 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 52 | 2.376 | 648 | 3.191 |
| Forderungen aus Einkünften | 338 | 399 | 633 | 1.016 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 890 | 4.095 | 409 | 1.006 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 99 | 74 | 0 | 649 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 0 | 22 | 0 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 10 | 2 | 0 | 23 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 2.398 | 3.801 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | 4 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 114.566 | 147.858 | 56.634 | 101.149 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (223) | (95) | (1.711) | (4.836) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | (1) | (1) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.224) | (7) | 0 | (1.060) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (314) | (181) | (77) | (143) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (237) | (262) | (58) | (123) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | (2.060) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 | (981) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (3) | (2) | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | 0 | (1.036) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (7) | (39) | 0 | (50) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.690) | (1.560) | (220) | 0 |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (805) | (5.007) | 0 | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (4.504) | (8.190) | (2.066) | (9.253) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 110.062 | $ 139.668 | $ 54.568 | $ 91.896 |

| Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets 2018 Fund | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 2.525.929 | $ 4.402.381 | $ 53.039 | $ 29.456 | $ 3.076.344 | $ 4.700.547 | $ 630.568 | $ 1.098.190 |
| 0 | 44.171 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 172.070 | 102.733 | 0 | 0 | 62.459 | 31.411 | 607 | 4.747 |
| 12.375 | 24.214 | 966 | 893 | 14.923 | 5.324 | 2.781 | 1.136 |
| 48.820 | 79.602 | 0 | 0 | 40.328 | 98.936 | 2.851 | 18.370 |
| 38.894 | 71.748 | 741 | 446 | 46.725 | 75.883 | 9.148 | 16.416 |
| 3.165 | 11.812 | 0 | 0 | 5.814 | 3.684 | 543 | 2.422 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 1.097 | 1.107 | 0 | 0 |
| 139 | 2.177 | 0 | 0 | 1.477 | 4.350 | 2 | 4 |
| 6.893 | 10.945 | 0 | 0 | 0 | 3.499 | 194 | 410 |
| 0 | 0 | 26 | 27 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 305 | 18 | 49.241 | 21.564 | 7.172 | 7.018 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 298 | 1 | 2 |
| 2.808.285 | 4.749.783 | 55.077 | 30.840 | 3.298.408 | 4.946.603 | 653.867 | 1.148.715 |
| (146.262) | (178.636) | (143) | (36) | (72.093) | (76.661) | (2.631) | (10.607) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1.092) | (1.104) | 0 | 0 |
| (119) | (57) | 0 | 0 | (112) | (64) | (7) | (11) |
| (6.473) | (9.613) | (875) | (608) | (14.054) | (5.976) | (814) | (1.107) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (657) | (18.617) | (17) | 0 | (1.091) | (5.891) | (130) | (1.006) |
| (2.453) | (4.408) | (22) | (10) | (3.198) | (4.402) | (470) | (1.118) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (2.343) | 0 | (36.976) | (30.028) | (15.818) | (2.741) |
| (402) | (2.351) | (28) | (28) | (9) | 0 | (1) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1.143) | 0 | 0 | 0 |
| (82.767) | (17.219) | 0 | 0 | (62.430) | (2.772) | (7.170) | (1.419) |
| 0 | 0 | (119) | (94) | (18.790) | (96.277) | (2.473) | (20.678) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (5.917) | (6.581) | 0 | 0 |
| (239.133) | (230.901) | (3.547) | (776) | (216.905) | (229.756) | (29.514) | (38.687) |
| $ 2.569.152 | $ 4.518.882 | $ 51.530 | $ 30.064 | $ 3.081.503 | $ 4.716.847 | $ 624.353 | $ 1.110.028 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund[3] | | PIMCO Emerging Multi-Asset Fund[4] | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 104.319 | $ 159.739 | $ 0 | $ 443.739 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 2.103 | 0 | 702 |
| Finanzderivate | 8.575 | 4.668 | 0 | 9.119 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 726 | 672 | 36 | 6.813 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.413 | 3.741 | 0 | 3.969 |
| Forderungen aus Einkünften | 569 | 1.833 | 0 | 3.733 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 20 | 4 | 0 | 233 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 0 | 0 | 3 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 15 | 36 | 0 | 0 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 69 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 115.637 | 172.796 | 36 | 468.380 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (4.540) | (8.077) | 0 | (8.026) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | (2) | (1) | 0 | (2) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (270) | 0 | 0 | (311) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (21) | (24) | (36) | (8) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (85) | (142) | 0 | (48) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | (16.151) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | (18) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | (419) |
| Einlagen von Kontrahenten | (5.570) | (287) | 0 | (3.450) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | (192) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | (18) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (10.488) | (8.531) | (36) | (28.643) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 105.149 | $ 164.265 | $ 0 | $ 439.737 |

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

(3) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund änderte am 30. September 2015 seinen Namen von Emerging Markets Currency Fund.

(4) Der PIMCO Emerging Multi-Asset Fund wurde am 31. Juli 2015 geschlossen.

(5) Der PIMCO EqS Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(6) Der PIMCO EqS Pathfinder Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(7) Der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

| PIMCO EqS Emerging Markets Fund[5] | | PIMCO EqS Pathfinder Fund™[6] | | PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™[7] | | Euro Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 0 | $ 566.263 | $ 0 | $ 197.085 | € 0 | € 38.789 | € 1.139.723 | € 1.067.186 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 11.071 | 0 | 2.947 | 0 | 520 | 28.137 | 28.635 |
| 39 | 6.301 | 53 | 400 | 2 | 47 | 6.433 | 7.079 |
| 0 | 4.647 | 0 | 1.210 | 0 | 0 | 8.296 | 7.594 |
| 0 | 661 | 0 | 125 | 1 | 54 | 8.026 | 10.190 |
| 0 | 250 | 0 | 0 | 0 | 97 | 14.017 | 5.590 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 138.004 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 14 | 0 | 39 | 857 | 592 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2.887 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 101 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 1.670 | 0 | 0 | 233 | 12 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 220 | 288 |
| 39 | 589.193 | 53 | 203.552 | 3 | 39.546 | 1.346.833 | 1.127.166 |
| 0 | (12.538) | 0 | (1.344) | 0 | (353) | (19.530) | (30.750) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (64.033) | 0 |
| 0 | (1) | 0 | (2) | 0 | 0 | (21) | (4) |
| 0 | 0 | 0 | (231) | 0 | 0 | (11.126) | (3.268) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (102.139) | 0 |
| (39) | 0 | (47) | (75) | (2) | (5) | (895) | (1.990) |
| 0 | (753) | 0 | 0 | 0 | (83) | (543) | (554) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (48.118) | (20.000) |
| 0 | (1.308) | (6) | (6) | (1) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (1.164) | 0 | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (6.550) |
| 0 | (3.560) | 0 | (1.250) | 0 | (260) | (15.025) | (2.359) |
| 0 | 0 | 0 | (3.457) | 0 | 0 | (194) | (44) |
| 0 | 0 | 0 | (8) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (39) | (19.324) | (53) | (6.376) | (3) | (701) | (261.624) | (65.519) |
| $ 0 | $ 569.869 | $ 0 | $ 197.176 | € 0 | € 38.845 | € 1.085.209 | € 1.061.647 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | € 434.712 | € 759.579 | € 780.964 | € 1.002.259 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 1.566 | 2.567 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 6.615 | 9.972 | 15.408 | 13.410 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 18.465 | 7.837 | 41.163 | 7.063 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.403 | 13.154 | 12.026 | 13.879 |
| Forderungen aus Einkünften | 5.316 | 10.338 | 11.548 | 17.211 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 241 | 414 | 551 | 797 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 85 | 29 | 1.230 | 2.223 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 1.537 | 0 | 3.432 | 478 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 2 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | 2 | 2 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 473.942 | 803.892 | 866.322 | 1.057.322 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (3.700) | (20.773) | (9.976) | (28.495) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | (9) | (1) | (42) | (3) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (9.699) | (887) | (16.563) | (1.710) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (225) | 0 | (1.599) | (2.717) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (274) | (599) | (743) | (972) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | (38.975) | 0 | (60.660) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (11.188) | 0 | (25.911) | (7.313) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | (13) | (6) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | (2.842) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (6.371) | (425) | (14.912) | (2.925) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | (1) | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (31.466) | (64.502) | (69.760) | (104.801) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 442.476 | € 739.390 | € 796.562 | € 952.521 |

| Euro Long Average Duration Fund | | Euro Low Duration Fund | | Euro Real Return Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| € 516.665 | € 643.455 | € 69.600 | € 230.709 | € 28.050 | € 26.706 | € 828.077 | € 576.872 |
| 737 | 5.300 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 745 |
| 4.489 | 19.238 | 1.005 | 893 | 96 | 190 | 2.125 | 1.169 |
| 3.883 | 2.580 | 680 | 196 | 573 | 390 | 30.944 | 286 |
| 4.724 | 1.388 | 506 | 137 | 91 | 140 | 699 | 1.310 |
| 6.042 | 7.597 | 917 | 3.510 | 153 | 87 | 7.135 | 6.039 |
| 1.098 | 2.526 | 1 | 0 | 141 | 115 | 52.071 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 505 | 5 | 36 | 0 | 0 | 5.945 | 1.377 |
| 4.278 | 0 | 0 | 0 | 21 | 0 | 6 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 22 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 3 |
| 541.916 | 682.590 | 72.736 | 235.484 | 29.125 | 27.628 | 927.003 | 587.801 |
| (8.361) | (13.805) | (926) | (1.831) | (406) | (648) | (1.541) | (2.236) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.804) | (1.285) | (2) | (1) | (11) | 0 | (65.411) | (1.373) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3) | 0 | (16) | (24) | 0 | 0 | (1.756) | (96) |
| (163) | (247) | (48) | (142) | (25) | (57) | (285) | (316) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (417) | 0 | 0 | 0 |
| (2.723) | (11.684) | (4.004) | 0 | 0 | 0 | (6.764) | (8.218) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (9.751) | (13) | (61) | 0 | (7) | 0 | 0 |
| (1.828) | (1.104) | (672) | (281) | 0 | 0 | (1.830) | (260) |
| 0 | 0 | (95) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (14.882) | (37.879) | (5.776) | (2.340) | (859) | (712) | (77.587) | (12.499) |
| € 527.034 | € 644.711 | € 66.960 | € 233.144 | € 28.266 | € 26.916 | € 849.416 | € 575.302 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Ultra-Long Duration Fund | | Global Advantage Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | € 48.417 | € 104.925 | $ 779.847 | $ 640.223 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.076 | 3.102 | 3.106 |
| Finanzderivate | 803 | 22.840 | 18.791 | 15.040 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 739 | 3.100 | 4.686 | 3.301 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 3.471 | 4.077 | 6.607 | 16.106 |
| Forderungen aus Einkünften | 351 | 693 | 5.148 | 6.282 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 201 | 771 | 1.655 | 4.295 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 22.693 | 4.340 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 9.699 | 48 | 33 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 1.264 | 0 | 4.559 | 3.839 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 13.710 | 7.473 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 0 | 14 |
| **Summe Aktiva** | 55.246 | 147.181 | 860.846 | 704.052 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (2.153) | (2.030) | (21.247) | (24.725) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | (12.796) | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | 0 | (19) | (7) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (163) | (1.561) | (1.850) | (3.274) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | (52.559) | (8.660) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | 0 | (80) | (44) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (40) | (69) | (260) | (147) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | (10.199) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | (29.102) | (723) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | (10) | (9) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | (14) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | (21.292) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | 0 | (14.735) | (3.681) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | (8.418) | (16.494) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (2.356) | (24.952) | (151.275) | (57.778) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 52.890 | € 122.229 | $ 709.571 | $ 646.274 |

| Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Dividend Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 694.398 | $ 899.165 | $ 8.745.587 | $ 8.925.017 | $ 730.475 | $ 798.166 | $ 68.061 | $ 84.498 |
| 0 | 1.998 | 52.443 | 82.613 | 7.903 | 7.910 | 0 | 0 |
| 11.406 | 12.517 | 271.014 | 442.110 | 14.693 | 32.431 | 221 | 487 |
| 5.390 | 4.220 | 44.244 | 25.601 | 5.210 | 3.429 | 673 | 1.724 |
| 2.817 | 8.354 | 76.280 | 47.787 | 12.288 | 5.249 | 0 | 530 |
| 4.423 | 6.685 | 57.056 | 78.990 | 5.179 | 7.210 | 174 | 132 |
| 76.577 | 16.573 | 28.255 | 135.559 | 5.402 | 7.048 | 895 | 1 |
| 0 | 31.323 | 1.122.638 | 944.412 | 105.568 | 80.937 | 0 | 0 |
| 31 | 81 | 3.415 | 7.652 | 472 | 750 | 3 | 230 |
| 100 | 6.120 | 41.948 | 15.420 | 4.462 | 4.319 | 0 | 0 |
| 0 | 9 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 6.278 | 6.548 | 108.325 | 24.615 | 701 | 170 | 2.114 | 1.849 |
| 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 801.420 | 993.593 | 10.551.206 | 10.729.776 | 892.353 | 947.619 | 72.141 | 89.451 |
| (9.486) | (18.322) | (216.474) | (234.844) | (20.024) | (22.337) | (274) | (158) |
| 0 | (11.438) | (462.963) | (755.903) | (45.058) | (55.850) | 0 | 0 |
| (4) | (285) | (197) | (607) | (12) | (750) | 0 | 0 |
| (14.881) | (983) | (29.101) | (68.310) | (4.762) | (4.584) | (899) | 0 |
| 0 | (19.935) | (1.565.925) | (819.872) | (79.693) | (44.290) | 0 | 0 |
| (174) | (162) | (2.362) | (3.960) | (5.462) | (237) | (79) | (201) |
| (290) | (243) | (3.842) | (3.215) | (462) | (394) | (33) | (4) |
| (49.397) | (232.471) | (2.010) | (829.155) | (20.183) | (102.975) | 0 | 0 |
| (242.458) | (39.357) | (132.852) | (68.445) | 0 | (1.141) | 0 | 0 |
| (75) | (99) | (278) | (24) | (56) | (43) | 0 | 0 |
| 0 | (2) | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | (650) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (7.480) | (5.387) | (222.689) | (210.695) | (7.467) | (16.056) | (1.020) | (520) |
| (3.311) | (7.045) | (57.865) | (125.037) | (262) | (578) | (695) | (2.453) |
| 0 | (4) | (1) | (6) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (327.556) | (335.733) | (2.696.559) | (3.120.074) | (183.441) | (249.235) | (3.000) | (3.986) |
| $ 473.864 | $ 657.860 | $ 7.854.647 | $ 7.609.702 | $ 708.912 | $ 698.384 | $ 69.141 | $ 85.465 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global High Yield Bond Fund | | Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.783.250 | $ 3.920.036 | $ 15.741.031 | $ 11.843.773 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 93.231 | 385.425 |
| Finanzderivate | 13.092 | 24.659 | 128.649 | 270.210 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.638 | 4.971 | 14.986 | 30.297 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 34.130 | 26.426 | 84.518 | 204.574 |
| Forderungen aus Einkünften | 57.558 | 57.588 | 150.211 | 118.673 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 4.352 | 1.663 | 30.964 | 51.783 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 156.890 | 141.921 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 37.072 | 3.115 | 17.209 | 12.630 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 832 | 0 | 53.165 | 0 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 34.961 | 12.886 | 161.923 | 62.550 |
| Sonstige Vermögenswerte | 108 | 0 | 0 | 223 |
| **Summe Aktiva** | 3.968.993 | 4.051.344 | 16.632.777 | 13.122.059 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (17.228) | (6.537) | (239.579) | (212.765) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | (75.396) | (69.652) |
| Zinsverbindlichkeiten | (72) | (18) | (387) | (122) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (22.575) | (4.854) | (88.275) | (24.242) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | (88.435) | (79.827) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (3.203) | (5.208) | (10.608) | (5.205) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (2.427) | (2.656) | (6.728) | (4.216) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | (120.010) | (68.825) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | (75.318) | (2.965.338) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (392) | (298) | (577) | (1) |
| Überziehungskredit | 0 | (36) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | (464) | 0 | (30.302) |
| Einlagen von Kontrahenten | (27.360) | (3.630) | (102.532) | (70.492) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (43.279) | (54.872) | (138.193) | (223.792) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (35) | (34) | (3) | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (116.571) | (153.925) | (3.836.061) | (789.441) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 3.852.422 | $ 3.897.419 | $ 12.796.716 | $ 12.332.618 |

| Global Low Duration Real Return Fund | | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 742.510 | $ 692.661 | $ 1.466.065 | $ 1.370.331 | $ 3.495.776 | $ 3.399.082 | $ 12.781.408 | $ 8.690.440 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 28.474 | 0 | 0 |
| 10.391 | 9.076 | 36.106 | 55.145 | 64.417 | 70.886 | 183.780 | 159.598 |
| 1.851 | 1.159 | 62.464 | 12.899 | 6.560 | 8.934 | 50.633 | 32.281 |
| 5.776 | 11.296 | 5.005 | 18.555 | 11.812 | 37.366 | 66.788 | 83.598 |
| 2.333 | 3.851 | 3.627 | 5.059 | 14.653 | 17.354 | 63.891 | 54.704 |
| 36.114 | 20.783 | 44.052 | 14.547 | 62.344 | 114.486 | 18.953 | 7.226 |
| 0 | 8.403 | 140.164 | 353.663 | 0 | 293.353 | 1.002.892 | 0 |
| 620 | 100 | 690 | 387 | 3.101 | 4.132 | 59.753 | 14.025 |
| 0 | 8.084 | 0 | 0 | 1.059 | 10.890 | 0 | 0 |
| 11 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 12.901 | 3.941 | 19.351 | 8.494 | 36.980 | 8.113 | 123.616 | 27.701 |
| 1 | 0 | 16 | 27 | 167 | 238 | 0 | 0 |
| 812.508 | 759.355 | 1.777.540 | 1.839.107 | 3.696.869 | 3.993.308 | 14.351.714 | 9.069.573 |
| (11.471) | (11.379) | (18.620) | (40.822) | (63.597) | (58.466) | (230.560) | (115.241) |
| 0 | (4.170) | 0 | (127.958) | 0 | (108.191) | (516.279) | 0 |
| 0 | (553) | (40) | (12) | (85) | (604) | (281) | (93) |
| (29.891) | (621) | (9.052) | (19.764) | (5.966) | (4.698) | (383.018) | (28.755) |
| 0 | (4.252) | (215.120) | (239.736) | 0 | (186.145) | (486.575) | 0 |
| (432) | (77) | (1.242) | (523) | (2.608) | (5.094) | (10.451) | (2.093) |
| (422) | (438) | (1.524) | (1.399) | (1.836) | (1.691) | (10.836) | (7.239) |
| (72.913) | (161.590) | (21.715) | (63.025) | (504.392) | (716.382) | 0 | 0 |
| (123.513) | 0 | (85.485) | 0 | (543.251) | (490.094) | (16.305) | (14.474) |
| (13) | (13) | 0 | 0 | (80) | (77) | (681) | (112) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (46) | 0 | (7.008) | (4.391) | 0 | 0 | (74.022) | (43.450) |
| (13.860) | (4.500) | (30.680) | (8.519) | (45.545) | (21.704) | (57.440) | (19.068) |
| (5.014) | (15.773) | (8.435) | (19.694) | (20.165) | (38.330) | (44.324) | (119.043) |
| 0 | (2) | (1) | (18) | (1) | 0 | (1) | 0 |
| (257.575) | (203.368) | (398.922) | (525.861) | (1.187.526) | (1.631.476) | (1.830.773) | (349.568) |
| $ 554.933 | $ 555.987 | $ 1.378.618 | $ 1.313.246 | $ 2.509.343 | $ 2.361.832 | $ 12.520.941 | $ 8.720.005 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 71.336 | $ 84.876 | $ 1.943.326 | $ 2.063.448 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.502 | 19.716 | 19.741 |
| Finanzderivate | 2.077 | 2.255 | 51.453 | 51.185 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.202 | 677 | 10.615 | 2.602 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.383 | 768 | 3.462 | 10.046 |
| Forderungen aus Einkünften | 370 | 534 | 5.672 | 7.944 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 2.607 | 1.483 | 2.270 | 16.530 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 7.311 | 175.595 | 3.358 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 86 | 22 | 7.624 | 2.919 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 491 | 4.558 | 3.206 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 16 | 17 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 419 | 133 | 9.504 | 4.565 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 279 | 224 |
| **Summe Aktiva** | 79.496 | 100.069 | 2.234.074 | 2.185.768 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (1.522) | (2.216) | (12.612) | (27.152) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | (5.213) | (2.230) | (2.238) |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | (1) | (41) | (35) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (765) | (163) | (1.061) | (1.492) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | (2.126) | (405.027) | (5.650) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (12) | 0 | (757) | (9.258) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (78) | (79) | (877) | (981) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (671) | (15.626) | (17.205) | (38.305) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (16.958) | (2.685) | (195.043) | (2.708) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (15) | (15) | (250) | (179) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (130) | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (2.750) | (1.000) | (51.400) | (22.830) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (302) | (352) | (6.018) | (16.787) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (23.203) | (29.476) | (692.521) | (127.615) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 56.293 | $ 70.593 | $ 1.541.553 | $ 2.058.153 |

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

(8) Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

(9) Der PIMCO RAE Fundamental Europe Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund[8] | PIMCO RAE Fundamental Europe Fund[9] |
|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2015 |
| $ 102.929 | $ 8.843 | $ 67.814 | $ 76.734 | $ 7.629 | € 28.117 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 188 | 85 | 8.555 | 3.158 | 0 | 0 |
| 581 | 150 | 684 | 742 | 32 | 224 |
| 401 | 45 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 479 | 79 | 136 | 152 | 18 | 29 |
| 56.394 | 6 | 8.847 | 229 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5 | 18 | 14 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 12 | 13 | 18 | 21 | 17 | 15 |
| 629 | 73 | 91 | 12 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 161.618 | 9.328 | 86.159 | 81.048 | 7.696 | 28.385 |
| (370) | (73) | (91) | (6) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (11) | 0 | 0 | 0 |
| (61.057) | (106) | (9.106) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (12) | 0 | 0 | 0 |
| (28) | (6) | (41) | (50) | (5) | (11) |
| 0 | (576) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (16.625) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (12) | (11) | (22) | (22) | (17) | (16) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (25) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (10) | 0 | (6.250) | (3.450) | 0 | 0 |
| (464) | (220) | (168) | (49) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (78.591) | (992) | (15.701) | (3.577) | (22) | (27) |
| $ 83.027 | $ 8.336 | $ 70.458 | $ 77.471 | $ 7.674 | € 28.358 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund[10] | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund[11] | | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund[12] | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 9.474 | $ 31.556 | $ 98.389 | $ 893.580 | $ 1.187.980 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 1.702 | 0 | 23.659 |
| Finanzderivate | 0 | 1.065 | 3.587 | 16.903 | 43.549 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 85 | 215 | 1.103 | 3.003 | 4.904 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 0 | 2.282 | 6.156 | 17.585 | 24.531 |
| Forderungen aus Einkünften | 10 | 284 | 799 | 7.327 | 7.663 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 0 | 5.904 | 149 | 2.300 | 22.740 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 8.963 | 17.591 | 156.806 | 253.286 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 0 | 0 | 27 | 17 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 187 | 1.385 | 9.460 | 17.398 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 18 | 13 | 10 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 26.205 | 18.962 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 0 | 47 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 9.587 | 50.469 | 130.871 | 1.133.243 | 1.604.689 |
| **Passiva:** | | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | | |
| Finanzderivate | 0 | (1.617) | (4.140) | (32.756) | (47.857) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | (3.606) | (12.442) | (82.933) | (168.650) |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | (53) | (19) | (350) | (45) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | (1.891) | (4.874) | (26.849) | (28.265) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | (5.387) | (5.196) | (76.186) | (85.379) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | 0 | (57) | (541) | (6) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (4) | (54) | (93) | (1.346) | (1.739) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | (6.439) | (14.703) | (59.836) | (136.429) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | (1.321) | 0 | (18.058) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (18) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | (27) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | (890) | (1.080) | (18.870) | (9.160) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | (10.582) | (39.411) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (22) | (21.258) | (42.631) | (328.307) | (516.941) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 9.565 | $ 29.211 | $ 88.240 | $ 804.936 | $ 1.087.748 |

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

[10] Der PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

[11] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von EM Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[12] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von Global Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[13] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von US Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[14] Der PIMCO RAE Fundamental US Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund[13] | | PIMCO RAE Fundamental US Fund[14] | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 322.054 | $ 445.469 | $ 12.810 | $ 295.265 | $ 323.463 |
| 1.801 | 8.402 | 0 | 0 | 0 |
| 9.431 | 18.513 | 0 | 3.628 | 1.756 |
| 2.770 | 1.484 | 52 | 927 | 734 |
| 1.281 | 5.064 | 0 | 2.256 | 4.877 |
| 1.068 | 2.895 | 13 | 4.275 | 5.301 |
| 3.177 | 1.194 | 0 | 3.983 | 5 |
| 69.421 | 25.877 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 11 | 305 |
| 1.830 | 4.106 | 0 | 43 | 202 |
| 11 | 7 | 17 | 0 | 0 |
| 2.029 | 3.167 | 0 | 3.404 | 1.450 |
| 0 | 0 | 0 | 56 | 49 |
| 414.873 | 516.178 | 12.892 | 313.848 | 338.142 |
| (6.086) | (10.366) | 0 | (4.976) | (2.785) |
| 0 | (23.838) | 0 | 0 | 0 |
| (44) | (16) | 0 | (2) | (1) |
| (5.441) | (1.478) | 0 | (3.898) | (7) |
| (97.225) | (24.270) | 0 | 0 | 0 |
| (53) | 0 | 0 | (6) | 0 |
| (238) | (329) | (4) | (235) | (245) |
| 0 | (387) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (2.465) |
| 0 | 0 | (18) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (11.035) | (17.438) | 0 | (3.820) | (55) |
| (637) | (8.946) | 0 | (1.051) | (6.782) |
| 0 | 0 | 0 | (110) | (110) |
| (120.759) | (87.068) | (22) | (14.098) | (12.450) |
| $ 294.114 | $ 429.110 | $ 12.870 | $ 299.750 | $ 325.692 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | StocksPLUS Fund™ | | Strategic Income Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.416.810 | $ 1.265.380 | $ 186.529 | $ 72.637 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 26.810 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 26.337 | 53.108 | 1.014 | 515 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 5.812 | 2.344 | 2.811 | 690 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.708 | 37.698 | 2.987 | 353 |
| Forderungen aus Einkünften | 4.925 | 3.518 | 686 | 260 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 13.237 | 15.679 | 2.686 | 7 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 334.712 | 0 | 8.481 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 85.506 | 1.328 | 222 | 768 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 0 | 118 | 0 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 14 | 20 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 1.490 | 5.201 | 4.392 | 600 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 15 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 1.894.537 | 1.411.081 | 209.940 | 75.850 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (19.813) | (13.214) | (3.353) | (865) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (79.603) | 0 | (3.309) | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | (118) | (21) | (4) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (22.192) | (17.486) | (12.365) | (779) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (255.133) | 0 | (5.167) | (622) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (103) | (397) | (179) | (21) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (348) | (614) | (226) | (92) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (71.495) | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (284.046) | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (9) | (9) | (22) | (21) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (6.638) | (40.033) | 0 | (100) |
| Einlagen von Kontrahenten | (15.670) | (13.311) | (3.240) | 0 |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (299) | (16.468) | (1.117) | (1.860) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (755.467) | (101.553) | (28.982) | (4.360) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 1.139.070 | $ 1.309.528 | $ 180.958 | $ 71.490 |

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

(15) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund[15] | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| $ 10.003.890 | $ 12.302.772 | $ 22.591 | £ 262.523 | £ 311.724 | £ 602.857 | £ 863.083 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 263.235 | 303.573 | 2.023 | 893 | 4.920 | 1.686 | 21.259 |
| 11.732 | 19.720 | 473 | 855 | 1.848 | 1.448 | 9.288 |
| 23.380 | 101.986 | 1.212 | 2.134 | 878 | 5.705 | 10.812 |
| 48.118 | 76.395 | 116 | 4.560 | 5.103 | 10.229 | 12.564 |
| 38.062 | 87.496 | 88 | 9.520 | 270 | 18.272 | 2.407 |
| 1.831.929 | 665.634 | 0 | 7.001 | 2.588 | 0 | 0 |
| 12.080 | 4.626 | 0 | 5 | 82 | 28 | 113 |
| 76.196 | 60.374 | 0 | 0 | 0 | 477 | 0 |
| 0 | 0 | 32 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 78.822 | 40.704 | 588 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.016 | 2.432 | 0 | 0 | 28 | 0 | 11 |
| 12.388.460 | 13.665.712 | 27.123 | 287.491 | 327.441 | 640.702 | 919.537 |
| (155.017) | (222.095) | (2.460) | (3.123) | (1.961) | (4.679) | (3.002) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (290) | (70) | 0 | (21) | 0 | (216) | (1) |
| (27.616) | (18.364) | (394) | (621) | (268) | (2.534) | (2.430) |
| (4.208.067) | (2.460.926) | 0 | (13.226) | (8.466) | 0 | 0 |
| (10.360) | (28.695) | 0 | 0 | 0 | (266) | (176) |
| (7.385) | (9.395) | (21) | (169) | (211) | (195) | (298) |
| (117.002) | (115.646) | 0 | (3.202) | 0 | (18.970) | 0 |
| (336.424) | (103.572) | (2.854) | (11.304) | 0 | (26.980) | 0 |
| (124) | 0 | (32) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (4) | 0 | (5.611) | 0 | (13.065) | 0 |
| 0 | 0 | (81) | (145) | (476) | 0 | (12.135) |
| (272.077) | (127.715) | 0 | (97) | (1.675) | (1.133) | (3.842) |
| (32.970) | (161.872) | (172) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (5.167.332) | (3.248.354) | (6.014) | (37.519) | (13.057) | (68.038) | (21.884) |
| $ 7.221.128 | $ 10.417.358 | $ 21.109 | £ 249.972 | £ 314.384 | £ 572.664 | £ 897.653 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | UK Low Duration Fund | | UK Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | £ 173.971 | £ 173.992 | £ 25.476 | £ 67.162 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 543 | 514 | 0 | 386 |
| Finanzderivate | 1.282 | 2.262 | 265 | 1.142 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 7.483 | 5.541 | 247 | 3.086 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.316 | 359 | 302 | 601 |
| Forderungen aus Einkünften | 1.574 | 1.653 | 97 | 322 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 318 | 66 | 84 | 1.168 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 13 | 34 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 786 | 1.447 | 71 | 685 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 0 | 0 | 2 |
| **Summe Aktiva** | 188.286 | 185.868 | 26.542 | 74.554 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (2.426) | (2.866) | (302) | (1.395) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | 0 | (4) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (11.469) | (50) | (27) | (1.053) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (60) | (72) | (10) | (23) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (5.219) | 0 | (577) | (20.567) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | (9.303) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | (33) | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (680) | (600) | (60) | (1.012) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (19.854) | (3.621) | (10.283) | (24.050) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | £ 168.432 | £ 182.247 | £ 16.259 | £ 50.504 |

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

(16) Der US High Yield Bond Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von High Yield Bond Fund.

| UK Sterling Long Average Duration Fund | | Unconstrained Bond Fund | | US High Yield Bond Fund[16] | | US Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
| £ 25.050 | £ 32.314 | $ 3.995.521 | $ 5.704.758 | $ 1.948.878 | $ 1.744.180 | $ 677.699 | $ 419.798 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1.601 | 1.603 |
| 146 | 604 | 390.477 | 469.281 | 579 | 1.871 | 1.915 | 391 |
| 235 | 2.824 | 7.114 | 17.966 | 2.695 | 4.308 | 3.975 | 543 |
| 184 | 105 | 41.230 | 62.049 | 10.606 | 13.116 | 899 | 1.970 |
| 192 | 368 | 24.240 | 32.283 | 31.745 | 25.393 | 3.689 | 2.379 |
| 108 | 1.822 | 75.728 | 55.360 | 1.745 | 298 | 6.922 | 98 |
| 0 | 0 | 756.372 | 2.088.546 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13 | 0 | 889 | 2.279 | 4.067 | 15.324 | 0 | 0 |
| 69 | 123 | 0 | 36.035 | 554 | 0 | 0 | 1.324 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 16 |
| 0 | 0 | 41.273 | 25.012 | 16.599 | 4.607 | 0 | 0 |
| 0 | 4 | 2.084 | 2.190 | 55 | 0 | 0 | 0 |
| 25.997 | 38.164 | 5.334.928 | 8.495.759 | 2.017.523 | 1.809.097 | 696.700 | 428.122 |
| (324) | (440) | (122.833) | (261.002) | (1.217) | (593) | (2.496) | (1.775) |
| 0 | 0 | (393.933) | (1.103.025) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (121) | (165) | (168) | (5) | (1) | (16) |
| (14) | (41) | (20.923) | (16.630) | (1.279) | (2.009) | (1.532) | (92) |
| 0 | 0 | (375.791) | (996.120) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (10.148) | (18.847) | (884) | (2.228) | 0 | 0 |
| (8) | (15) | (1.770) | (2.396) | (1.147) | (1.090) | (119) | (9) |
| (9.335) | (16.538) | (9.785) | (286.561) | 0 | 0 | 0 | (5.882) |
| 0 | 0 | (1.028.160) | (129.588) | 0 | 0 | (59.405) | (37.139) |
| 0 | 0 | 0 | (1) | (391) | (340) | (33) | (22) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (27.580) | 0 | 0 | (173) | (686) | 0 |
| (250) | (367) | (303.200) | (225.022) | (12.280) | (580) | (380) | 0 |
| 0 | 0 | (31.735) | (106.334) | (16.282) | (19.353) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (2) | 0 | 0 | 0 | 0 | (2) |
| (9.931) | (17.401) | (2.325.981) | (3.145.691) | (33.648) | (26.371) | (64.652) | (44.937) |
| £ 16.066 | £ 20.763 | $ 3.008.947 | $ 5.350.068 | $ 1.983.875 | $ 1.782.726 | $ 632.048 | $ 383.185 |

# Finanzstatus (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | US Small Cap StocksPLUS™ Fund[17] Zum 31. Dez. 2015 | Summe der Gesellschaft* Zum 31. Dez. 2015 | Summe der Gesellschaft* Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 74.913 | $ 97.121.492 | $ 102.079.710 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 183.099 | 665.147 |
| Finanzderivate | 955 | 1.965.982 | 2.771.543 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.633 | 492.537 | 360.394 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 653 | 764.043 | 1.228.982 |
| Forderungen aus Einkünften | 384 | 844.047 | 1.033.983 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 603 | 714.168 | 820.323 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 11.709 | 6.075.618 | 5.045.391 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 219.345 | 102.869 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 234.190 | 224.018 |
| Forderungen an die Verwaltungsgesellschaft | 13 | 244 | 288 |
| Unrealisierte Wertzunahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | 988.019 | 412.164 |
| Sonstige Vermögenswerte | 0 | 4.077 | 6.352 |
| **Summe Aktiva** | 90.863 | 109.606.861 | 114.751.164 |
| **Passiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | |
| Finanzderivate | (985) | (1.802.536) | (2.044.967) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (3.523) | (1.756.198) | (2.499.345) |
| Zinsverbindlichkeiten | 0 | (3.417) | (4.134) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (896) | (921.545) | (343.839) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (8.221) | (8.066.478) | (5.090.467) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | (83.391) | (127.606) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (23) | (86.518) | (63.413) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (4.365) | (1.204.571) | (3.018.908) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (22.721) | (6.694.474) | (2.227.881) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (15) | (4.083) | (5.315) |
| Überziehungskredit | 0 | (28.087) | (2.937) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (540) | (118.372) | (209.635) |
| Einlagen von Kontrahenten | (10) | (1.598.158) | (986.715) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | 0 | (592.505) | (1.505.177) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | (10.143) | (7.091) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (41.299) | (22.970.476) | (18.137.430) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 49.564 | $ 86.636.385 | $ 96.613.734 |

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

[17] Der US Small Cap StocksPLUS™ Fund wurde am 25. Februar 2015.

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2015 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den PIMCO Capital Securities Fund, den Emerging Markets Corporate Bond Fund, den Global Advantage Real Return Fund, den Income Fund und den StocksPLUS™ Fund Rechnung zu tragen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Emerging Asia Bond Fund, des Emerging Local Bond Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des Total Return Bond Fund und des Unconstrained Bond Fund in den US Short-Term Fund sowie Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Verwaltungsratsmitglied: William R. Benz

Datum: 26. April 2016

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

# Betriebsergebnisrechnung

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia Local Bond Fund[1] | | PIMCO Capital Securities Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 153 | $ 160 | $ 273.154 | $ 156.186 |
| Bankzinsen | 0 | 0 | 859 | 323 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 303 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (710) | (25) | (205.916) | (13.601) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 21 | 21 | (8.974) | (27.228) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 47 | (5) | (75.021) | (69.366) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 158 | 27 | (96.260) | (256.675) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (12) | 32 | 7.160 | (7.689) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (20) | 22 | 29.825 | (10.148) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (363) | 232 | (75.173) | (227.895) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (41) | (44) | (55.186) | (31.359) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (33) | (9) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | (2.661) | (1.449) |
| Zinsaufwendungen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | (75) | (2) |
| Gesamtaufwendungen | (41) | (44) | (57.955) | (32.819) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (41) | (44) | (57.955) | (32.819) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (404) | 188 | (133.128) | (260.714) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | 0 | 0 | (798) | (140) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (1) | (1) | (81.550) | (49.414) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 0 | 1.702 | 76.725 |
| Summe Finanzierungskosten | (1) | (1) | (80.646) | 27.171 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (405) | 187 | (213.774) | (233.543) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (10) | (17) | (5.932) | (1.395) |
| Kapitalertragsteuer | (4) | (1) | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (419) | 169 | (219.706) | (234.938) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (419) | $ 169 | $ (219.706) | $ (234.938) |

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

(1) Der PIMCO Asia Local Bond Fund wurde am 15. September 2015 geschlossen.

(2) Der Commodity Real Return Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von CommoditiesPLUS™ Strategy Fund.

| Commodity Real Return Fund[2] | | PIMCO Credit Absolute Return Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 10.309 | $ 8.434 | $ 47.427 | $ 53.097 | $ 336.583 | $ 509.445 | $ 46.427 | $ 108.338 |
| 171 | 58 | 469 | 126 | 1.498 | 1.043 | 200 | 219 |
| 0 | 0 | 110 | 0 | 171 | 8 | 25 | 4 |
| (8.879) | (1.129) | (60.834) | 10.299 | (376.591) | 73.052 | (100.974) | 36.603 |
| (131.565) | (40.491) | (34.076) | 3.751 | 88.702 | 124.493 | (20.303) | (47.159) |
| 1.789 | 13 | (191.757) | (128.385) | (388.390) | (350.120) | (96.621) | (80.427) |
| (9.190) | (1.613) | (1.012) | (47.401) | (116.420) | (485.079) | 28.439 | (140.777) |
| 21.794 | (16.606) | 5.235 | (13.815) | (76.624) | 34.062 | 6.740 | (54.380) |
| 1.389 | (5.083) | 58.126 | (62.325) | 79.809 | (251.069) | 18.981 | (70.325) |
| (114.182) | (56.417) | (176.312) | (184.653) | (451.262) | (344.165) | (117.086) | (247.904) |
| (3.646) | (3.802) | (16.282) | (22.895) | (72.361) | (114.227) | (9.367) | (29.960) |
| (24) | (17) | 0 | 0 | (67) | (131) | (32) | (10) |
| 0 | 0 | (88) | (100) | (148) | (191) | 0 | 0 |
| (1.302) | (220) | (234) | (13) | (2.357) | (1) | (722) | 0 |
| 0 | 0 | (1) | (17) | (12) | (45) | (1) | (1) |
| (4.972) | (4.039) | (16.605) | (23.025) | (74.945) | (114.595) | (10.122) | (29.971) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (4.972) | (4.039) | (16.605) | (23.025) | (74.945) | (114.595) | (10.122) | (29.971) |
| (119.154) | (60.456) | (192.917) | (207.678) | (526.207) | (458.760) | (127.208) | (277.875) |
| (526) | (23) | (304) | (71) | (1.437) | (1.625) | (289) | (334) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (23) | (1) | (12.782) | (11.430) | (103.890) | (241.756) | (17.179) | (32.674) |
| (1) | 440 | 88 | (1.813) | (3.336) | (76.645) | (471) | (45.602) |
| (550) | 416 | (12.998) | (13.314) | (108.663) | (320.026) | (17.939) | (78.610) |
| (119.704) | (60.040) | (205.915) | (220.992) | (634.870) | (778.786) | (145.147) | (356.485) |
| (1) | 0 | (83) | (364) | 101 | (124) | 0 | 7 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 797 | (116) | 0 |
| (119.705) | (60.040) | (205.998) | (221.356) | (634.769) | (778.113) | (145.263) | (356.478) |
| $ (119.705) | $ (60.040) | $ (205.998) | $ (221.356) | $ (634.769) | $ (778.113) | $ (145.263) | $ (356.478) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Dividend and Income Builder Fund | | Emerging Asia Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 5.078 | $ 6.791 | $ 3.116 | $ 7.505 |
| Bankzinsen | 22 | 9 | 12 | 12 |
| Sonstige Erträge | 1 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (4.568) | 8.136 | (3.483) | 296 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 317 | (98) | 325 | 354 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (11.004) | (5.480) | (8.296) | (1.594) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (13.014) | (8.265) | 3.188 | 755 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (29) | 18 | (459) | 760 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 2.645 | (3.345) | 2.569 | (2.168) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (20.552) | (2.234) | (3.028) | 5.920 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (2.375) | (2.782) | (983) | (2.483) |
| Servicegebühr | (11) | (6) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | (1) | (4) | (4) | (1) |
| Sonstige Aufwendungen | (2) | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (2.389) | (2.792) | (987) | (2.484) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (2.389) | (2.792) | (987) | (2.484) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (22.941) | (5.026) | (4.015) | 3.436 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (11) | (3) | (6) | (7) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (3.424) | (5.095) | (3.335) | (6.186) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (17) | (590) | 113 | (3.671) |
| Summe Finanzierungskosten | (3.452) | (5.688) | (3.228) | (9.864) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (26.393) | (10.714) | (7.243) | (6.428) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (705) | (1.054) | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | (16) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (27.098) | (11.768) | (7.243) | (6.444) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (27.098) | $ (11.768) | $ (7.243) | $ (6.444) |

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

(3) Der Emerging Markets 2018 Fund wurde am 31. Oktober 2014 aufgelegt.

| Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets 2018 Fund[3] | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 31.Okt. bis zum 31. Dez. 2014 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 191.981 | $ 303.148 | $ 1.981 | $ 104 | $ 237.018 | $ 297.750 | $ 49.766 | $ 80.536 |
| 593 | 337 | 0 | 0 | 700 | 321 | 157 | 63 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| (659.971) | (391.087) | (83) | 0 | (224.748) | (38.780) | (70.277) | (1.921) |
| 4.254 | (19.713) | 11 | 1 | (7.276) | 22.593 | (593) | 1.449 |
| (231.284) | (24.223) | (689) | (30) | (310.973) | (209.649) | (46.266) | (41.155) |
| 21.742 | (191.392) | (455) | (405) | (113.410) | (174.770) | (10.423) | (62.866) |
| (5.219) | 45.586 | (9) | (19) | 16.538 | (23.390) | 3.166 | (3.766) |
| 114.792 | (8.689) | 262 | (76) | 120.512 | (135.988) | 16.534 | (38.431) |
| (563.112) | (286.033) | 1.018 | (425) | (281.639) | (261.913) | (57.936) | (66.090) |
| (34.128) | (55.932) | (208) | (12) | (36.627) | (49.177) | (11.657) | (22.117) |
| (135) | (267) | (5) | (1) | (52) | (104) | (7) | (19) |
| (1) | (4) | 0 | 0 | (123) | (193) | (16) | (34) |
| (3) | (18) | 0 | 0 | (8) | 0 | 0 | 0 |
| (4) | 0 | 0 | (27) | (4) | (42) | (1) | 0 |
| (34.271) | (56.221) | (213) | (40) | (36.814) | (49.516) | (11.681) | (22.170) |
| 0 | 0 | 0 | 27 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (34.271) | (56.221) | (213) | (13) | (36.814) | (49.516) | (11.681) | (22.170) |
| (597.383) | (342.254) | 805 | (438) | (318.453) | (311.429) | (69.617) | (88.260) |
| (594) | (337) | 0 | 0 | (182) | (216) | (35) | (57) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (77.190) | (107.004) | (1.501) | 0 | (117.968) | (143.173) | (20.455) | (19.674) |
| (666) | (31.624) | 93 | (1) | (540) | (16.261) | 223 | (21.162) |
| (78.450) | (138.965) | (1.408) | (1) | (118.690) | (159.650) | (20.267) | (40.893) |
| (675.833) | (481.219) | (603) | (439) | (437.143) | (471.079) | (89.884) | (129.153) |
| (6.781) | (5.682) | 0 | 0 | 657 | 3.668 | (1) | 0 |
| 2.006 | (1.471) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (680.608) | (488.372) | (603) | (439) | (436.486) | (467.411) | (89.885) | (129.153) |
| $ (680.608) | $ (488.372) | $ (603) | $ (439) | $ (436.486) | $ (467.411) | $ (89.885) | $ (129.153) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund[4] | | PIMCO Emerging Multi-Asset Fund[5] | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 3.858 | $ 5.732 | $ 7.958 | $ 20.782 |
| Bankzinsen | 17 | 17 | 18 | 10 |
| Sonstige Erträge | 0 | 1 | 11 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (12.730) | (13.074) | (35.854) | (13.924) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 403 | (2.340) | 533 | (7.712) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (12.362) | (2.124) | (3.408) | 3.738 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 4.060 | (2.825) | 33.619 | (15.935) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (401) | 3.014 | (2.525) | 3.216 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 8.054 | (3.154) | 1.168 | (1.793) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (9.101) | (14.753) | 1.520 | (11.617) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (1.554) | (2.848) | (193) | (515) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | 0 | 0 | (14) | (38) |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | (18) | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (1.554) | (2.848) | (225) | (553) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (1.554) | (2.848) | (225) | (553) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (10.655) | (17.601) | 1.295 | (12.170) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (15) | (19) | (11) | (10) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (37) | (59) | (6.268) | (18.782) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (2) | (2.150) | 0 | (163) |
| Summe Finanzierungskosten | (54) | (2.228) | (6.279) | (18.955) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (10.709) | (19.829) | (4.984) | (31.125) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (28) | 96 | (257) | (893) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 12 | (322) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (10.737) | (19.733) | (5.229) | (32.340) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (10.737) | $ (19.733) | $ (5.229) | $ (32.340) |

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

(4) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund änderte am 30. September 2015 seinen Namen von Emerging Markets Currency Fund.

(5) Der PIMCO Emerging Multi-Asset Fund wurde am 31. Juli 2015 geschlossen.

(6) Der PIMCO EqS Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(7) Der PIMCO EqS Pathfinder Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(8) Der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

| PIMCO EqS Emerging Markets Fund[6] | | PIMCO EqS Pathfinder Fund™[7] | | PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™[8] | | Euro Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 2.370 | $ 30.249 | $ 2.593 | $ 12.702 | € 669 | € 1.735 | € 23.527 | € 21.927 |
| 43 | 49 | 15 | 18 | 2 | 0 | 99 | 23 |
| 0 | 0 | 3 | 0 | 0 | 1 | 0 | 4 |
| 12.058 | (48.278) | 6.723 | 94.079 | 12.291 | 1.998 | 38.744 | 34.908 |
| 1.455 | (29.372) | (4.586) | (1.029) | (1.038) | 48 | (29.875) | 26.105 |
| (2.397) | (7.248) | (2.785) | 1.103 | 363 | (211) | (36.001) | (11.706) |
| 9.970 | 3.203 | 8.064 | (110.711) | (5.106) | (764) | (23.451) | 49.721 |
| (460) | (519) | (111) | (541) | 0 | (43) | (8.655) | (2.301) |
| 1.949 | (199) | 149 | (9.632) | (167) | 46 | 48.395 | 1.447 |
| 24.988 | (52.115) | 10.065 | (14.011) | 7.014 | 2.810 | 12.783 | 120.128 |
| (3.130) | (16.400) | (1.126) | (4.776) | (409) | (855) | (6.253) | (5.657) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (177) | (235) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (20) | (29) |
| (11) | (140) | (35) | (67) | (12) | (4) | (929) | (10) |
| (1) | (1) | 0 | 0 | (3) | 0 | (21) | 0 |
| (3.142) | (16.541) | (1.161) | (4.843) | (424) | (859) | (7.400) | (5.931) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3.142) | (16.541) | (1.161) | (4.843) | (424) | (859) | (7.400) | (5.931) |
| 21.846 | (68.656) | 8.904 | (18.854) | 6.590 | 1.951 | 5.383 | 114.197 |
| (26) | (57) | (10) | (20) | (1) | (1) | (71) | (7) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (5.702) | 0 | (1.323) | 0 | (39) | (1.135) | (876) |
| 0 | (13.923) | 0 | (6.851) | 0 | (205) | 116 | 648 |
| (26) | (19.682) | (10) | (8.194) | (1) | (245) | (1.090) | (235) |
| 21.820 | (88.338) | 8.894 | (27.048) | 6.589 | 1.706 | 4.293 | 113.962 |
| (215) | (2.522) | 1.741 | (2.014) | 242 | (119) | 0 | 0 |
| (547) | (2.910) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 21.058 | (93.770) | 10.635 | (29.062) | 6.831 | 1.587 | 4.293 | 113.962 |
| $ 21.058 | $ (93.770) | $ 10.635 | $ (29.062) | € 6.831 | € 1.587 | € 4.293 | € 113.962 |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | € 14.285 | € 11.986 | € 42.480 | € 28.650 |
| Bankzinsen | 91 | 30 | 145 | 45 |
| Sonstige Erträge | 11 | 4 | 25 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 58.455 | 8.148 | 26.108 | 4.318 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 2.062 | 11.879 | (3.228) | 11.600 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (62.883) | (26.874) | (86.720) | (37.815) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (13.857) | 46.666 | 7.495 | 36.292 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (5.080) | 3.271 | (4.448) | (1.333) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 18.386 | (14.440) | 28.951 | (17.707) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 11.470 | 40.670 | 10.808 | 24.051 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (4.854) | (4.650) | (10.911) | (8.617) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (54) | (59) |
| Zinsaufwendungen | (692) | (179) | (839) | (255) |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | 0 | (6) | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (5.547) | (4.829) | (11.810) | (8.931) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (5.547) | (4.829) | (11.810) | (8.931) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 5.923 | 35.841 | (1.002) | 15.120 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (107) | (20) | (102) | (37) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (1.486) | (2.008) | (26.253) | (19.813) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (108) | 7.302 | 343 | 27.748 |
| Summe Finanzierungskosten | (1.701) | 5.274 | (26.012) | 7.898 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 4.222 | 41.115 | (27.014) | 23.018 |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 4.222 | 41.115 | (27.014) | 23.018 |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 4.222 | € 41.115 | € (27.014) | € 23.018 |

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

| Euro Long Average Duration Fund | | Euro Low Duration Fund | | Euro Real Return Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| € 10.849 | € 12.834 | € 2.962 | € 6.018 | € 499 | € 236 | € 3.926 | € 4.871 |
| 29 | 7 | 4 | 2 | 0 | 0 | 9 | 3 |
| 0 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 79.385 | 10.088 | 7.736 | 8.062 | 1.113 | 757 | 6.587 | 962 |
| 14.433 | 26.502 | (2.433) | 375 | (13) | 169 | (1.339) | 138 |
| (13.582) | (5.345) | (4.662) | (2.130) | (44) | (110) | (3.103) | (2.659) |
| (74.197) | 78.736 | (4.390) | 2.716 | (180) | 812 | (6.208) | 4.673 |
| (12.137) | 9.597 | (258) | 1.351 | 35 | (298) | 423 | (212) |
| 2.613 | 18.077 | 1.054 | (631) | 87 | (98) | 817 | (2) |
| 7.393 | 150.501 | 13 | 15.763 | 1.497 | 1.468 | 1.112 | 7.774 |
| (2.594) | (2.370) | (1.196) | (2.827) | (135) | (117) | (2.620) | (2.223) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (2) | (8) |
| (4) | (42) | (6) | 0 | (608) | (7) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (1) | 0 |
| (2.598) | (2.412) | (1.202) | (2.827) | (743) | (124) | (2.623) | (2.231) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2.598) | (2.412) | (1.202) | (2.827) | (743) | (124) | (2.623) | (2.231) |
| 4.795 | 148.089 | (1.189) | 12.936 | 754 | 1.344 | (1.511) | 5.543 |
| (20) | (16) | (8) | (2) | (1) | (1) | (11) | (3) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 818 | 0 | (2.572) | 0 | 22 | 0 | 3.323 |
| (20) | 802 | (8) | (2.574) | (1) | 21 | (11) | 3.320 |
| 4.775 | 148.891 | (1.197) | 10.362 | 753 | 1.365 | (1.522) | 8.863 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.775 | 148.891 | (1.197) | 10.362 | 753 | 1.365 | (1.522) | 8.863 |
| € 4.775 | € 148.891 | € (1.197) | € 10.362 | € 753 | € 1.365 | € (1.522) | € 8.863 |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Ultra-Long Duration Fund | | Global Advantage Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | € 1.049 | € 1.907 | $ 18.012 | $ 17.820 |
| Bankzinsen | 3 | 3 | 117 | 64 |
| Sonstige Erträge | 1 | 0 | 1 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 4.732 | 4.025 | (37.197) | 3.541 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 24.220 | 9.592 | (3.634) | 947 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (2.232) | (837) | (38.317) | (21.374) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (2.682) | 1.966 | (20.143) | (18.156) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (22.897) | 22.333 | 412 | (6.163) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 3.629 | 881 | 19.774 | (7.782) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 5.823 | 39.870 | (60.975) | (31.102) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (391) | (462) | (5.267) | (5.589) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | (10) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | 0 | (218) | (39) | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | (4) | (1) | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (391) | (684) | (5.307) | (5.599) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (391) | (684) | (5.307) | (5.599) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 5.432 | 39.186 | (66.282) | (36.701) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (6) | (86) | (143) | (20) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | 0 | (2.851) | (2.964) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | (479) | (64) | (726) |
| Summe Finanzierungskosten | (6) | (565) | (3.058) | (3.710) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 5.426 | 38.621 | (69.340) | (40.411) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | (177) | (73) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 5.426 | 38.621 | (69.517) | (40.484) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 5.426 | € 38.621 | $ (69.517) | $ (40.484) |

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

| Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Dividend Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 22.139 | $ 24.947 | $ 239.369 | $ 294.376 | $ 17.919 | $ 21.699 | $ 3.500 | $ 21.236 |
| 126 | 32 | 1.752 | 494 | 194 | 50 | 11 | 17 |
| 0 | 0 | 80 | 10 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| (120.964) | 2.706 | (511.837) | 154.089 | (40.565) | 6.904 | (8.316) | 129.495 |
| (16.027) | (2.650) | 20.130 | (27.764) | (2.709) | 6.625 | 38 | 4.617 |
| (7.755) | (400) | 178.697 | 42.579 | 71.683 | 33.243 | (4.718) | 13.837 |
| (1.766) | (19.443) | (112.783) | (293.883) | (20.606) | (14.970) | (6.429) | (131.001) |
| 6.048 | (7.150) | (16.263) | (31.685) | 1.682 | (8.413) | 0 | 0 |
| 2.270 | 832 | (30.526) | 134.157 | (21.059) | 26.430 | 1.638 | (17.914) |
| (115.929) | (1.126) | (231.381) | 272.373 | 6.539 | 71.568 | (14.276) | 20.288 |
| | | | | | | | |
| (6.883) | (5.094) | (50.128) | (49.196) | (4.290) | (3.914) | (1.439) | (6.272) |
| (41) | (33) | (2.620) | (2.534) | (49) | (47) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (120) | (116) | (76) | (76) | 0 | 0 |
| (1.288) | (1.866) | (12.237) | (22.150) | (1.490) | (1.615) | (2) | (20) |
| 0 | 0 | (14) | (1) | (1) | 0 | (1) | 0 |
| (8.212) | (6.993) | (65.119) | (73.997) | (5.906) | (5.652) | (1.442) | (6.292) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8.212) | (6.993) | (65.119) | (73.997) | (5.906) | (5.652) | (1.442) | (6.292) |
| | | | | | | | |
| (124.141) | (8.119) | (296.500) | 198.376 | 633 | 65.916 | (15.718) | 13.996 |
| | | | | | | | |
| (1.031) | (234) | (2.132) | (2.162) | (264) | (786) | (8) | (30) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3.717) | (4.607) | (44.284) | (47.559) | (1.554) | (2.358) | (2.474) | (13.004) |
| (53) | (1.402) | (909) | (11.421) | (7) | 1.496 | 56 | (18.012) |
| (4.801) | (6.243) | (47.325) | (61.142) | (1.825) | (1.648) | (2.426) | (31.046) |
| | | | | | | | |
| (128.942) | (14.362) | (343.825) | 137.234 | (1.192) | 64.268 | (18.144) | (17.050) |
| (117) | (77) | (49) | (1) | 0 | 0 | 635 | (3.486) |
| 36 | (116) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (129.023) | (14.555) | (343.874) | 137.233 | (1.192) | 64.268 | (17.509) | (20.536) |
| | | | | | | | |
| $ (129.023) | $ (14.555) | $ (343.874) | $ 137.233 | $ (1.192) | $ 64.268 | $ (17.509) | $ (20.536) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global High Yield Bond Fund | | Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 222.883 | $ 310.151 | $ 481.524 | $ 550.394 |
| Bankzinsen | 574 | 231 | 1.753 | 879 |
| Sonstige Erträge | 121 | 4 | 3 | 364 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (54.979) | 160.827 | (79.474) | 99.060 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 2.888 | 5.273 | 74.186 | 318.618 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (138.839) | (60.465) | (544.870) | (438.993) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (236.893) | (383.226) | (479.427) | (146.262) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (1.266) | (11.416) | (112.449) | 50.700 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 12.979 | (79.282) | 131.973 | (316.593) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (192.532) | (57.903) | (526.781) | 118.167 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (28.104) | (38.720) | (78.924) | (101.141) |
| Servicegebühr | (66) | (53) | (2.233) | (3.104) |
| Bestandspflegegebühr | (664) | (1.321) | (1.039) | (1.312) |
| Zinsaufwendungen | 0 | (18) | (2.672) | (784) |
| Sonstige Aufwendungen | (11) | (8) | (65) | (2) |
| Gesamtaufwendungen | (28.845) | (40.120) | (84.933) | (106.343) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (28.845) | (40.120) | (84.933) | (106.343) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (221.377) | (98.023) | (611.714) | 11.824 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (432) | (229) | (4.107) | (845) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | (300) | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (92.589) | (116.950) | (157.810) | (211.795) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 1.790 | (58.802) | 1.723 | (99.053) |
| Summe Finanzierungskosten | (91.531) | (175.981) | (160.194) | (311.693) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (312.908) | (274.004) | (771.908) | (299.869) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | (35) | (357) | (723) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 26 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (312.908) | (274.013) | (772.265) | (300.592) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (312.908) | $ (274.013) | $ (772.265) | $ (300.592) |

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

(9) Der Global Low Duration Real Return Fund wurde am 18. Februar 2014 aufgelegt.

| Global Low Duration Real Return Fund[9] | | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 18. Feb. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 3.140 | $ 712 | $ 24.136 | $ 32.413 | $ 54.648 | $ 82.343 | $ 333.818 | $ 251.223 |
| 120 | 30 | 313 | 113 | 761 | 134 | 1.141 | 195 |
| 0 | 0 | 20 | 1 | 0 | 0 | 1.416 | 0 |
| (33.181) | (2.241) | (18.563) | 5.621 | (196.462) | 16.925 | (52.440) | 46.707 |
| (12.340) | 1.610 | (38.941) | 6.825 | (24.634) | (28.573) | 10.078 | (8.185) |
| (34.193) | (14.451) | (58.176) | 9.827 | 24.105 | 52.702 | (193.627) | (82.619) |
| 10.317 | (28.161) | 4.804 | 33.788 | (73.715) | 27.182 | (257.648) | (161.840) |
| 8.280 | (8.366) | 11.465 | 13.128 | 9.083 | (20.779) | (8.115) | 51.716 |
| 12.571 | (5.160) | 20.783 | (46.170) | 24.696 | 1.837 | 100.886 | (40.597) |
| (45.286) | (56.027) | (54.159) | 55.546 | (181.518) | 131.771 | (64.491) | 56.600 |
| (4.666) | (2.191) | (17.802) | (22.282) | (20.884) | (23.727) | (103.369) | (66.228) |
| 0 | 0 | (36) | (38) | (526) | (731) | (892) | (307) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (702) | (842) | (4.045) | (2.122) |
| (759) | (490) | (324) | (359) | (4.098) | (12.373) | (223) | (141) |
| (1) | (14) | (2) | (17) | (3) | 0 | (83) | (8) |
| (5.426) | (2.695) | (18.164) | (22.696) | (26.213) | (37.673) | (108.612) | (68.806) |
| 0 | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (5.426) | (2.693) | (18.164) | (22.696) | (26.213) | (37.673) | (108.612) | (68.806) |
| (50.712) | (58.720) | (72.323) | 32.850 | (207.731) | 94.098 | (173.103) | (12.206) |
| (542) | (99) | (416) | (136) | (4.169) | (1.586) | (558) | (161) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (72) | (271) | (2.181) | (1.939) | (6.381) | (5.036) | (229.791) | (149.334) |
| (213) | 6.722 | 198 | 28.122 | (574) | (29.838) | (9.835) | 85.603 |
| (827) | 6.352 | (2.399) | 26.047 | (11.124) | (36.460) | (240.184) | (63.892) |
| (51.539) | (52.368) | (74.722) | 58.897 | (218.855) | 57.638 | (413.287) | (76.098) |
| (12) | 0 | 99 | (616) | (120) | 0 | (82) | (1) |
| 0 | 0 | (1) | 1 | 85 | (85) | 0 | 4 |
| (51.551) | (52.368) | (74.624) | 58.282 | (218.890) | 57.553 | (413.369) | (76.095) |
| $ (51.551) | $ (52.368) | $ (74.624) | $ 58.282 | $ (218.890) | $ 57.553 | $ (413.369) | $ (76.095) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 2.031 | $ 1.556 | $ 40.108 | $ 48.397 |
| Bankzinsen | 7 | 1 | 168 | 92 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (8.179) | (888) | (53.064) | 3.640 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (4.682) | 1.401 | (6.162) | 8.004 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 2.092 | 820 | (39.782) | 12.773 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 13 | (1.983) | (672) | (70.215) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.087 | (1.174) | 744 | (6.843) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (275) | 1.112 | 28.708 | (17.839) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (7.906) | 845 | (29.952) | (21.990) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (894) | (643) | (10.727) | (16.939) |
| Servicegebühr | (6) | (8) | (422) | (743) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | (72) | (511) |
| Zinsaufwendungen | (78) | (26) | (97) | (137) |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | (3) | (1) |
| Gesamtaufwendungen | (978) | (677) | (11.321) | (18.331) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (978) | (677) | (11.321) | (18.331) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (8.884) | 168 | (41.273) | (40.321) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (57) | (5) | (577) | (163) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (19) | (8) | (8.520) | (11.114) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (7) | 436 | (623) | (18.736) |
| Summe Finanzierungskosten | (83) | 423 | (9.720) | (30.013) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (8.967) | 591 | (50.993) | (70.334) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (39) | (8) | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 2 | (5) | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (9.004) | 578 | (50.993) | (70.334) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (9.004) | $ 578 | $ (50.993) | $ (70.334) |

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

(10) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund wurde am 28. Februar 2014 aufgelegt.

(11) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund wurde am 25. November 2014 aufgelegt.

(12) Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

(13) Der PIMCO RAE Fundamental Europe Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund[10] | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund[11] | | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund[12] | PIMCO RAE Fundamental Europe Fund[13] |
|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 28. Feb. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 25. Nov. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 |
| $ 330 | $ 119 | $ 716 | $ 82 | $ 163 | € 277 |
| 0 | 0 | 53 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (291) | (13) | (3.909) | 0 | (243) | (816) |
| 40 | 1 | (20.023) | (6.732) | 0 | 0 |
| (1.081) | (326) | 26 | (6) | 0 | 18 |
| (241) | (228) | (822) | (230) | (2.193) | (2.681) |
| (29) | (25) | 5.308 | 3.155 | 0 | 1 |
| 185 | (109) | (35) | (43) | (1) | (1) |
| (1.087) | (580) | (18.686) | (3.774) | (2.274) | (3.202) |
| (129) | (42) | (617) | (55) | (33) | (62) |
| 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (4) | (1) | 0 | 0 | (3) | 0 |
| 0 | (13) | 0 | (22) | (18) | (17) |
| (133) | (56) | (618) | (77) | (54) | (79) |
| 0 | 12 | 0 | 21 | 18 | 16 |
| (133) | (44) | (618) | (56) | (36) | (63) |
| (1.220) | (624) | (19.304) | (3.830) | (2.310) | (3.265) |
| 0 | 0 | (19) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1) | (1) | (3.539) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 44 | 9 | 0 | 0 | 0 |
| (1) | 43 | (3.549) | 0 | 0 | 0 |
| (1.221) | (581) | (22.853) | (3.830) | (2.310) | (3.265) |
| 0 | 0 | (75) | (9) | (17) | (13) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.221) | (581) | (22.928) | (3.839) | (2.327) | (3.278) |
| $ (1.221) | $ (581) | $ (22.928) | $ (3.839) | $ (2.327) | € (3.278) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund[14] | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund[15] | | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund[16] | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 125 | $ 1.901 | $ 2.554 | $ 23.818 | $ 18.263 |
| Bankzinsen | 0 | 34 | 5 | 658 | 61 |
| Sonstige Erträge | 0 | 1 | 1 | 1 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (25) | (5.920) | 2.226 | (48.501) | 3.750 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 0 | (14.809) | (1.379) | (82.722) | 13.145 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (6) | 3.849 | 1.917 | (71.289) | 28.807 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (755) | 1.627 | (2.428) | (5.740) | (37.127) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 0 | 461 | 172 | (2.941) | (20.639) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 0 | (658) | 1.131 | 28.283 | (4.160) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (661) | (13.514) | 4.199 | (158.433) | 2.101 |
| **Betriebskosten** | | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (25) | (769) | (2.114) | (16.035) | (17.681) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | 0 | (94) | (57) | (882) | (344) |
| Sonstige Aufwendungen | (18) | 0 | (5) | (1) | (6) |
| Gesamtaufwendungen | (43) | (863) | (2.176) | (16.918) | (18.031) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 18 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (25) | (863) | (2.176) | (16.918) | (18.031) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (686) | (14.377) | 2.023 | (175.351) | (15.930) |
| **Finanzierungskosten** | | | | | |
| Zinsaufwendungen | 0 | (37) | (7) | (514) | (90) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | 0 | 0 | (2.865) | (1.075) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 0 | (2.360) | 64 | (30.648) |
| Summe Finanzierungskosten | 0 | (37) | (2.367) | (3.315) | (31.813) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (686) | (14.414) | (344) | (178.666) | (47.743) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (28) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (714) | (14.414) | (344) | (178.666) | (47.743) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (714) | $ (14.414) | $ (344) | $ (178.666) | $ (47.743) |

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

[14] Der PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

[15] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von EM Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[16] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von Global Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[17] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von US Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[18] Der PIMCO RAE Fundamental US Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund[17] | | PIMCO RAE Fundamental US Fund[18] | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 9.085 | $ 5.982 | $ 132 | $ 16.586 | $ 17.257 |
| 148 | 33 | 0 | 29 | 11 |
| 1 | 1 | 0 | 0 | 0 |
| (30.987) | 1.878 | (58) | (7.387) | (4.315) |
| (20.575) | 34.053 | 0 | 378 | 973 |
| 3.079 | (3.463) | (1) | (17.947) | (12.883) |
| 4.268 | (18.710) | (368) | (21.335) | (2.705) |
| (1.417) | (1.939) | 0 | (280) | (514) |
| 2.765 | 4.254 | 0 | 7.776 | (5.783) |
| (33.633) | 22.089 | (295) | (22.180) | (7.959) |
| (3.536) | (3.094) | (20) | (2.899) | (3.004) |
| 0 | 0 | 0 | (34) | (25) |
| (64) | (2) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (17) | 0 | 0 |
| (3.600) | (3.096) | (37) | (2.933) | (3.029) |
| 0 | 0 | 17 | 0 | 0 |
| (3.600) | (3.096) | (20) | (2.933) | (3.029) |
| (37.233) | 18.993 | (315) | (25.113) | (10.988) |
| (154) | (40) | 0 | (18) | (4) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (266) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2) | (668) | 0 | 0 | 440 |
| (422) | (708) | 0 | (18) | 436 |
| (37.655) | 18.285 | (315) | (25.131) | (10.552) |
| 0 | 0 | (40) | 0 | (22) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 33 |
| (37.655) | 18.285 | (355) | (25.131) | (10.541) |
| $ (37.655) | $ 18.285 | $ (355) | $ (25.131) | $ (10.541) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | StocksPLUS™ Fund | | Strategic Income Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 17.529 | $ 9.754 | $ 4.300 | $ 773 |
| Bankzinsen | 78 | 43 | 13 | 0 |
| Sonstige Erträge | 0 | 35 | 14 | 4 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (19.961) | (13.324) | (4.528) | (124) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 28.718 | 115.272 | 1.047 | (47) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (28.554) | (45.904) | (9.396) | (1.565) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 880 | (17.667) | (6.831) | (872) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (32.235) | 16.716 | (1.024) | 110 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 9.021 | 4.757 | 3.836 | (931) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (24.524) | 69.682 | (12.569) | (2.652) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (6.615) | (7.154) | (1.914) | (347) |
| Servicegebühr | (16) | (9) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | (411) | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (1) | (4) | (21) |
| Gesamtaufwendungen | (7.043) | (7.164) | (1.918) | (368) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 20 |
| Betriebskosten, netto | (7.043) | (7.164) | (1.918) | (348) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (31.567) | 62.518 | (14.487) | (3.000) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (352) | (43) | (16) | (1) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (1.473) | (2.161) | (1.611) | (483) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 4 | 2.848 | (50) | 2.587 |
| Summe Finanzierungskosten | (1.821) | 644 | (1.677) | 2.103 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (33.388) | 63.162 | (16.164) | (897) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | (325) | (56) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (33.388) | 63.162 | (16.489) | (953) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (33.388) | $ 63.162 | $ (16.489) | $ (953) |

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

(19) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund[19] | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 234.597 | $ 438.451 | $ 130 | £ 12.064 | £ 14.590 | £ 29.935 | £ 38.681 |
| 1.373 | 675 | 7 | 6 | 3 | 22 | 9 |
| 0 | 92 | 0 | 2 | 0 | 49 | 7 |
| (83.937) | 105.534 | (15) | 9.936 | 9.352 | 31.164 | 37.365 |
| 11.404 | 2.967 | (942) | 1.407 | 4.827 | 22.067 | 16.750 |
| (464.224) | (278.603) | (1.050) | 5.210 | 1.676 | 10.950 | 3.798 |
| (211.246) | 82.608 | (80) | (17.767) | 15.607 | (58.218) | 43.262 |
| (27.265) | (249.446) | 138 | (1.542) | 1.904 | (16.262) | 17.159 |
| 207.223 | (120.475) | (158) | (3.569) | (167) | (5.125) | 989 |
| (332.075) | (18.197) | (1.970) | 5.747 | 47.792 | 14.582 | 158.020 |
| (76.981) | (149.230) | (95) | (1.269) | (1.699) | (3.007) | (4.070) |
| (2.988) | (6.694) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2.811) | (4.249) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (3.531) | (602) | 0 | (609) | 0 | (1.473) | 0 |
| (216) | 0 | (32) | (14) | 0 | (11) | 0 |
| (86.527) | (160.775) | (127) | (1.892) | (1.699) | (4.491) | (4.070) |
| 0 | 0 | 31 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (86.527) | (160.775) | (96) | (1.892) | (1.699) | (4.491) | (4.070) |
| (418.602) | (178.972) | (2.066) | 3.855 | 46.093 | 10.091 | 153.950 |
| (2.594) | (518) | (3) | (103) | (7) | (239) | (13) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (22.818) | (37.586) | 0 | 0 | 0 | (7.363) | (14.568) |
| (1.486) | (243.073) | 0 | 0 | (4.242) | (784) | (3.429) |
| (26.898) | (281.177) | (3) | (103) | (4.249) | (8.386) | (18.010) |
| (445.500) | (460.149) | (2.069) | 3.752 | 41.844 | 1.705 | 135.940 |
| (247) | (2.461) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (445.747) | (462.610) | (2.069) | 3.752 | 41.844 | 1.705 | 135.940 |
| $ (445.747) | $ (462.610) | $ (2.069) | £ 3.752 | £ 41.844 | £ 1.705 | £ 135.940 |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | UK Low Duration Fund | | UK Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | £ 3.611 | £ 2.061 | £ 591 | £ 2.031 |
| Bankzinsen | 4 | 1 | 1 | 1 |
| Sonstige Erträge | 0 | 1 | 0 | 1 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (1.121) | 562 | 5.361 | 3.235 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (1.173) | (1.782) | (1.133) | (1.381) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 2.876 | (331) | 952 | 12 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (1.609) | 3.573 | (5.533) | 7.869 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 896 | (1.051) | 477 | (476) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (1.389) | 829 | (301) | 161 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 2.095 | 3.863 | 415 | 11.453 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (716) | (547) | (184) | (305) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zinsaufwendungen | (369) | (21) | (67) | (530) |
| Sonstige Aufwendungen | (2) | 0 | (2) | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (1.087) | (568) | (253) | (835) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (1.087) | (568) | (253) | (835) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 1.008 | 3.295 | 162 | 10.618 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (83) | (9) | (120) | (118) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (167) | (144) | (2) | (141) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (5) | 1.739 | 5 | (462) |
| Summe Finanzierungskosten | (255) | 1.586 | (117) | (721) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 753 | 4.881 | 45 | 9.897 |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 753 | 4.881 | 45 | 9.897 |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | £ 753 | £ 4.881 | £ 45 | £ 9.897 |

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

(20) Der US High Yield Bond Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von High Yield Bond Fund.

(21) Der US Short-Term Fund wurde am 30. Juni 2014 aufgelegt.

| UK Sterling Long Average Duration Fund | | Unconstrained Bond Fund | | US High Yield Bond Fund[20] | | US Short-Term Fund[21] | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2014 bis 31. Dez. 2014 |
| £ 1.182 | £ 1.681 | $ 153.374 | $ 217.297 | $ 111.094 | $ 120.030 | $ 8.282 | $ 1.431 |
| 0 | 0 | 970 | 591 | 206 | 51 | 10 | 1 |
| 10 | 2 | 41 | 14 | 87 | 267 | 18 | 0 |
| 1.547 | 1.312 | (228.864) | (157.671) | (253) | 68.617 | (347) | (62) |
| (213) | (609) | (110.844) | 93.595 | 2.077 | 4.620 | (844) | 57 |
| 626 | 174 | (245.695) | (219.026) | (83.565) | (42.408) | 2.581 | 602 |
| (2.216) | 3.434 | 18.855 | (156.173) | (154.655) | (103.594) | (3.939) | (1.204) |
| (68) | 276 | (19.035) | (55.923) | (754) | (5.858) | 2.599 | (1.467) |
| (289) | (27) | 154.396 | 5.120 | 13.918 | (30.585) | 0 | 210 |
| 579 | 6.243 | (276.802) | (272.176) | (111.845) | 11.140 | 8.360 | (432) |
| (81) | (120) | (43.381) | (110.215) | (13.187) | (14.994) | (803) | (43) |
| 0 | 0 | (501) | (1.360) | (751) | (1.072) | (96) | 0 |
| 0 | 0 | (1.184) | (2.846) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (423) | (481) | (7.307) | (744) | 0 | (2) | (12) | (2) |
| 0 | 0 | (4) | 0 | (2) | (1) | 0 | (22) |
| (504) | (601) | (52.377) | (115.165) | (13.940) | (16.069) | (911) | (67) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 15 |
| (504) | (601) | (52.377) | (115.165) | (13.940) | (16.069) | (911) | (52) |
| 75 | 5.642 | (329.179) | (387.341) | (125.785) | (4.929) | 7.449 | (484) |
| (83) | (79) | (3.176) | (659) | (173) | (71) | (136) | (18) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (151) | 0 | 0 | 0 |
| (26) | (35) | (6.126) | (11.681) | (31.876) | (31.531) | (4.914) | (1.393) |
| 0 | (592) | (304) | (157.087) | 187 | (14.268) | 2 | 0 |
| (109) | (706) | (9.606) | (169.427) | (32.013) | (45.870) | (5.048) | (1.411) |
| (34) | 4.936 | (338.785) | (556.768) | (157.798) | (50.799) | 2.401 | (1.895) |
| 0 | 0 | (15) | (24) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (34) | 4.936 | (338.800) | (556.792) | (157.798) | (50.799) | 2.401 | (1.895) |
| £ (34) | £ 4.936 | $ (338.800) | $ (556.792) | $ (157.798) | $ (50.799) | $ 2.401 | $ (1.895) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | US Small Cap StocksPLUS™ Fund[22] Berichtszeitraum vom 25. Feb. 2015 bis 31. Dez. 2015 | Summe der Gesellschaft* Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Summe der Gesellschaft* Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr** |
|---|---|---|---|
| **Erträge** | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 990 | $ 3.428.027 | $ 4.292.074 |
| Bankzinsen | 2 | 15.866 | 6.582 |
| Sonstige Erträge | 0 | 2.259 | 1.154 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (56) | (3.067.057) | 493.811 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (7.072) | (292.210) | 664.918 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (52) | (3.276.675) | (2.048.044) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (443) | (2.109.660) | (2.548.912) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (102) | (285.124) | (263.799) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (11) | 1.286.528 | (1.129.555) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | (6.744) | (4.298.046) | (531.771) |
| **Betriebskosten** | | | |
| Verwaltungsgebühr | (303) | (790.267) | (1.057.276) |
| Servicegebühr | 0 | (11.902) | (17.733) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | (13.772) | (15.405) |
| Zinsaufwendungen | (64) | (48.293) | (44.885) |
| Sonstige Aufwendungen | (15) | (731) | (282) |
| Gesamtaufwendungen | (382) | (864.965) | (1.135.581) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 13 | 115 | 97 |
| Betriebskosten, netto | (369) | (864.850) | (1.135.484) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | (7.113) | (5.162.896) | (1.667.255) |
| **Finanzierungskosten** | | | |
| Zinsaufwendungen | (34) | (27.228) | (11.428) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | (451) | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | (1.094.849) | (1.334.637) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | (13.717) | (663.966) |
| Summe Finanzierungskosten | (34) | (1.136.245) | (2.010.031) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | (7.147) | (6.299.141) | (3.677.286) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | (12.226) | (18.045) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 1.473 | (4.064) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | (7.147) | (6.309.894) | (3.699.395) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ (7.147) | $ (6.309.894) | $ (3.699.395) |

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

[22] Der US Small Cap StocksPLUS™ Fund wurde am 25. Februar 2015.

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2015 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den PIMCO Capital Securities Fund, den Emerging Markets Corporate Bond Fund, den Global Advantage Real Return Fund, den Income Fund und den StocksPLUS™ Fund Rechnung zu tragen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Emerging Asia Bond Fund, des Emerging Local Bond Fund, des Emerging Markets Corporate Bond Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des StocksPLUS™ Fund, des Total Return Bond Fund, des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund und des Unconstrained Bond Fund in den US Short-Term Fund Rechnung zu tragen.

** Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2014 wurde nicht angepasst, um die Schließung des US Government Money Market Fund am 24. September 2014 zu berücksichtigen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

# Ausweis der Nettovermögensänderungen

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia Local Bond Fund[1] | | PIMCO Capital Securities Fund | | Commodity Real Return Fund[2] | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 5.413 | $ 4.835 | $ 4.502.515 | $ 706.888 | $ 298.408 | $ 528.288 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 1.099 | 579 | 3.908.229 | 5.300.943 | 319.630 | 239.731 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 1 | 31.791 | 29.721 | 5 | 1 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (6.094) | (171) | (2.102.825) | (1.300.099) | (147.978) | (409.572) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (419) | 169 | (219.706) | (234.938) | (119.705) | (60.040) |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 0 | $ 5.413 | $ 6.120.004 | $ 4.502.515 | $ 350.360 | $ 298.408 |

| (Angaben in Tausend) | Emerging Asia Bond Fund | | Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets 2018 Fund[3] | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 31.Okt. bis zum 31. Dez. 2014 |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 91.896 | $ 501.485 | $ 4.518.882 | $ 5.957.198 | $ 30.064 | $ 0 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 10.424 | 20.476 | 606.474 | 2.534.792 | 23.187 | 30.503 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 15 | 660 | 20.447 | 40.149 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (40.524) | (424.281) | (1.896.043) | (3.524.885) | (1.118) | 0 |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (7.243) | (6.444) | (680.608) | (488.372) | (603) | (439) |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 54.568 | $ 91.896 | $ 2.569.152 | $ 4.518.882 | $ 51.530 | $ 30.064 |

| (Angaben in Tausend) | PIMCO EqS Emerging Markets Fund[6] | | PIMCO EqS Pathfinder Fund™[7] | | PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™[8] | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 569.869 | $ 1.467.945 | $ 197.176 | $ 902.229 | € 38.845 | € 41.545 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 12.099 | 686.590 | 5.599 | 127.833 | 6.979 | 10.273 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 5.702 | 0 | 1.307 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (603.026) | (1.496.598) | (213.410) | (805.131) | (52.655) | (14.560) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | 21.058 | (93.770) | 10.635 | (29.062) | 6.831 | 1.587 |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 0 | $ 569.869 | $ 0 | $ 197.176 | € 0 | € 38.845 |

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

(1) Der PIMCO Asia Local Bond Fund wurde am 15. September 2015 geschlossen.

(2) Der Commodity Real Return Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von CommoditiesPLUS™ Strategy Fund.

(3) Der Emerging Markets 2018 Fund wurde am 31. Oktober 2014 aufgelegt.

(4) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund änderte am 30. September 2015 seinen Namen von Emerging Markets Currency Fund.

(5) Der PIMCO Emerging Multi-Asset Fund wurde am 31. Juli 2015 geschlossen.

(6) Der PIMCO EqS Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(7) Der PIMCO EqS Pathfinder Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

(8) Der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ wurde am 30. Juni 2015 geschlossen.

| PIMCO Credit Absolute Return Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | | PIMCO Dividend and Income Builder Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 1.682.122 | $ 1.632.332 | $ 7.483.173 | $ 12.507.776 | $ 1.672.466 | $ 3.242.670 | $ 139.668 | $ 157.014 |
| 153.061 | 1.209.242 | 1.990.285 | 4.631.396 | 499.716 | 769.910 | 91.222 | 214.801 |
| 4.573 | 4.781 | 10.732 | 11.362 | 440 | 11.732 | 324 | 427 |
| (634.424) | (942.877) | (3.139.477) | (8.889.248) | (970.814) | (1.995.368) | (94.054) | (220.806) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (205.998) | (221.356) | (634.769) | (778.113) | (145.263) | (356.478) | (27.098) | (11.768) |
| $ 999.334 | $ 1.682.122 | $ 5.709.944 | $ 7.483.173 | $ 1.056.545 | $ 1.672.466 | $ 110.062 | $ 139.668 |

| Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund[4] | | PIMCO Emerging Multi-Asset Fund[5] | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| $ 4.716.847 | $ 5.671.748 | $ 1.110.028 | $ 1.845.162 | $ 164.265 | $ 547.889 | $ 439.737 | $ 461.425 |
| 1.361.002 | 2.648.791 | 164.577 | 410.534 | 33.351 | 80.084 | 1.369 | 3.919 |
| 21.904 | 32.887 | 10.645 | 16.469 | 7 | 8 | 3.832 | 18.772 |
| (2.581.764) | (3.169.168) | (571.012) | (1.032.984) | (81.737) | (443.983) | (439.709) | (12.039) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (436.486) | (467.411) | (89.885) | (129.153) | (10.737) | (19.733) | (5.229) | (32.340) |
| $ 3.081.503 | $ 4.716.847 | $ 624.353 | $ 1.110.028 | $ 105.149 | $ 164.265 | $ 0 | $ 439.737 |

| Euro Bond Fund | | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | | Euro Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| € 1.061.647 | € 921.055 | € 739.390 | € 305.514 | € 952.521 | € 316.620 | € 644.711 | € 366.137 |
| 837.596 | 638.329 | 74.741 | 485.169 | 385.505 | 813.579 | 139.510 | 213.920 |
| 14 | 77 | 1.458 | 2.009 | 56 | 138 | 0 | 0 |
| (818.341) | (611.776) | (377.335) | (94.417) | (514.506) | (200.834) | (261.962) | (84.237) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.293 | 113.962 | 4.222 | 41.115 | (27.014) | 23.018 | 4.775 | 148.891 |
| € 1.085.209 | € 1.061.647 | € 442.476 | € 739.390 | € 796.562 | € 952.521 | € 527.034 | € 644.711 |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Low Duration Fund | | Euro Real Return Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | € 233.144 | € 654.889 | € 26.916 | € 23.809 | € 575.302 | € 475.088 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 103.361 | 495.374 | 8.454 | 2.563 | 1.008.441 | 409.366 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (268.348) | (927.481) | (7.857) | (821) | (732.805) | (318.015) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (1.197) | 10.362 | 753 | 1.365 | (1.522) | 8.863 |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | € 66.960 | € 233.144 | € 28.266 | € 26.916 | € 849.416 | € 575.302 |

| (Angaben in Tausend) | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Dividend Fund | | Global High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 698.384 | $ 649.619 | $ 85.465 | $ 1.412.539 | $ 3.897.419 | $ 6.111.190 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 348.121 | 209.239 | 58.507 | 116.539 | 3.503.670 | 3.571.395 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 686 | 824 | 253 | 9.020 | 7.912 | 12.112 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (337.087) | (225.566) | (57.575) | (1.432.097) | (3.243.671) | (5.523.265) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (1.192) | 64.268 | (17.509) | (20.536) | (312.908) | (274.013) |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 708.912 | $ 698.384 | $ 69.141 | $ 85.465 | $ 3.852.422 | $ 3.897.419 |

| (Angaben in Tausend) | Income Fund | | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 8.720.005 | $ 4.280.433 | $ 70.593 | $ 46.120 | $ 2.058.153 | $ 4.255.625 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 7.615.908 | 8.073.932 | 37.801 | 33.471 | 1.178.491 | 1.650.237 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 37.828 | 39.638 | 0 | 0 | 2.915 | 4.095 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (3.439.431) | (3.575.363) | (43.097) | (9.576) | (1.647.013) | (3.781.470) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (413.369) | (98.635) | (9.004) | 578 | (50.993) | (70.334) |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 12.520.941 | $ 8.720.005 | $ 56.293 | $ 70.593 | $ 1.541.553 | $ 2.058.153 |

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

(9) Der Global Low Duration Real Return Fund wurde am 18. Februar 2014 aufgelegt.

(10) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund wurde am 28. Februar 2014 aufgelegt.

(11) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund wurde am 25. November 2014 aufgelegt.

(12) Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

(13) Der PIMCO RAE Fundamental Europe Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

(14) Der PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

(15) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von EM Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

| | Euro Ultra-Long Duration Fund | | Global Advantage Fund | | Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| | € 122.229 | € 88.082 | $ 646.274 | $ 722.577 | $ 657.860 | $ 535.454 | $ 7.609.702 | $ 8.122.826 |
| | 62.149 | 50.997 | 201.444 | 71.252 | 538.511 | 383.940 | 3.141.653 | 2.595.754 |
| | 0 | 0 | 2.653 | 2.407 | 1.604 | 434 | 14.380 | 19.708 |
| | (136.914) | (55.471) | (71.283) | (109.478) | (595.088) | (247.413) | (2.567.214) | (3.265.819) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 5.426 | 38.621 | (69.517) | (40.484) | (129.023) | (14.555) | (343.874) | 137.233 |
| | € 52.890 | € 122.229 | $ 709.571 | $ 646.274 | $ 473.864 | $ 657.860 | $ 7.854.647 | $ 7.609.702 |

| | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Low Duration Real Return Fund[9] | | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 18. Feb. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| | $ 12.332.618 | $ 17.428.685 | $ 555.987 | $ 0 | $ 1.313.246 | $ 3.084.359 | $ 2.361.832 | $ 3.561.225 |
| | 6.361.002 | 5.701.800 | 477.242 | 822.467 | 504.444 | 48.345 | 2.341.598 | 2.037.954 |
| | 16.806 | 12.540 | 72 | 16 | 40 | 102 | 2.611 | 2.002 |
| | (5.141.445) | (10.509.815) | (426.817) | (214.128) | (364.488) | (1.877.842) | (1.977.808) | (3.296.902) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (772.265) | (300.592) | (51.551) | (52.368) | (74.624) | 58.282 | (218.890) | 57.553 |
| | $ 12.796.716 | $ 12.332.618 | $ 554.933 | $ 555.987 | $ 1.378.618 | $ 1.313.246 | $ 2.509.343 | $ 2.361.832 |

| | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund[10] | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund[11] | | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund[12] | PIMCO RAE Fundamental Europe Fund[13] | PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund[14] | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund[15] |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 28. Feb. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 25. Nov. 2014 bis 31. Dez. 2014 | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr |
| | $ 8.336 | $ 0 | $ 77.471 | $ 0 | $ 0 | € 0 | $ 0 | $ 88.240 |
| | 84.108 | 10.240 | 38.359 | 81.310 | 10.001 | 41.563 | 10.303 | 24.046 |
| | 1 | 1 | 178 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (8.197) | (1.324) | (22.622) | 0 | 0 | (9.927) | (24) | (68.661) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (1.221) | (581) | (22.928) | (3.839) | (2.327) | (3.278) | (714) | (14.414) |
| | $ 83.027 | $ 8.336 | $ 70.458 | $ 77.471 | $ 7.674 | € 28.358 | $ 9.565 | $ 29.211 |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund[16] | | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund[17] | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 186.978 | $ 1.087.748 | $ 197.859 | $ 429.110 | $ 87.029 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 121.435 | 519.581 | 2.841.277 | 162.366 | 602.179 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 2.862 | 1.075 | 254 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (219.829) | (626.589) | (1.904.720) | (259.961) | (278.383) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (344) | (178.666) | (47.743) | (37.655) | 18.285 |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 88.240 | $ 804.936 | $ 1.087.748 | $ 294.114 | $ 429.110 |

| (Angaben in Tausend) | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund[19] | UK Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 10.417.358 | $ 21.368.184 | $ 0 | £ 314.384 | £ 372.072 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 1.865.262 | 3.457.692 | 29.578 | 14.707 | 99.843 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7.994 | 9.945 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (4.623.739) | (13.955.853) | (6.400) | (82.871) | (199.375) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (445.747) | (462.610) | (2.069) | 3.752 | 41.844 |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 7.221.128 | $ 10.417.358 | $ 21.109 | £ 249.972 | £ 314.384 |

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

[16] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von Global Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[17] Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund änderte am 30. Juni 2015 seinen Namen von US Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund.

[18] Der PIMCO RAE Fundamental US Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

[19] Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund wurde am 30. Juni 2015 aufgelegt.

| | PIMCO RAE Fundamental US Fund[18] | | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | | StocksPLUS Fund™ | | Strategic Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2015 bis 31. Dez. 2015 | | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| | $ | 0 | $ 325.692 | $ 300.756 | $ 1.309.528 | $ 270.284 | $ 71.490 | $ 5.119 |
| | | 13.225 | 72.969 | 104.838 | 911.604 | 1.810.541 | 165.674 | 69.107 |
| | | 0 | 0 | 0 | 1.449 | 2.144 | 97 | 87 |
| | | 0 | (73.780) | (69.361) | (1.050.123) | (836.603) | (39.814) | (1.870) |
| | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | (355) | (25.131) | (10.541) | (33.388) | 63.162 | (16.489) | (953) |
| | $ | 12.870 | $ 299.750 | $ 325.692 | $ 1.139.070 | $ 1.309.528 | $ 180.958 | $ 71.490 |

| | UK Long Term Corporate Bond Fund | | UK Low Duration Fund | | UK Real Return Fund | | UK Sterling Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
| £ | 897.653 | £ 984.628 | £ 182.247 | £ 104.147 | £ 50.504 | £ 60.008 | £ 20.763 | £ 27.048 |
| | 29.374 | 28.247 | 102.152 | 126.805 | 5.770 | 7.560 | 2.940 | 1.195 |
| | 3 | 1 | 30 | 67 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (356.071) | (251.163) | (116.750) | (53.653) | (40.060) | (26.961) | (7.603) | (12.416) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 1.705 | 135.940 | 753 | 4.881 | 45 | 9.897 | (34) | 4.936 |
| £ | 572.664 | £ 897.653 | £ 168.432 | £ 182.247 | £ 16.259 | £ 50.504 | £ 16.066 | £ 20.763 |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Unconstrained Bond Fund | | US High Yield Bond Fund[20] | | US Short-Term Fund[21] | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Berichtszeitraum vom 30. Juni 2014 bis 31. Dez. 2014 |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 5.350.068 | $ 12.454.085 | $ 1.782.726 | $ 2.263.996 | $ 383.185 | $ 0 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 795.741 | 3.466.736 | 1.869.638 | 1.751.533 | 400.488 | 385.729 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1.526 | 4.977 | 5.823 | 9.280 | 4.792 | 1.393 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (2.799.588) | (10.018.938) | (1.516.514) | (2.191.284) | (158.818) | (2.042) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber | (338.800) | (556.792) | (157.798) | (50.799) | 2.401 | (1.895) |
| **Schlusswert zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 3.008.947 | $ 5.350.068 | $ 1.983.875 | $ 1.782.726 | $ 632.048 | $ 383.185 |

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

[20] Der US High Yield Bond Fund änderte am 31. März 2015 seinen Namen von High Yield Bond Fund.

[21] Der US Short-Term Fund wurde am 30. Juni 2014 aufgelegt.

[22] Der US Small Cap StocksPLUS™ Fund wurde am 25. Februar 2015.

* Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2015 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Global Multi-Asset Fund in den PIMCO Capital Securities Fund, den Emerging Markets Corporate Bond Fund, den Global Advantage Real Return Fund, den Income Fund und den StocksPLUS™ Fund Rechnung zu tragen. Darüber hinaus wurde der Betrag bereinigt, um Überkreuzinvestitionen des Diversified Income Fund, des Diversified Income Duration Hedged Fund, des Emerging Asia Bond Fund, des Emerging Local Bond Fund, des Emerging Markets Corporate Bond Fund, des Global Bond Fund, des Low Average Duration Fund, des StocksPLUS™ Fund, des Total Return Bond Fund, des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund und des Unconstrained Bond Fund in den US Short-Term Fund Rechnung zu tragen.

** Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2014 wurde nicht angepasst, um die Schließung des US Government Money Market Fund am 24. September 2014 zu berücksichtigen.

| US Small Cap StocksPLUS™ Fund[22] | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|
| Berichtszeitraum vom 25. Feb. 2015 bis 31. Dez. 2015 | Am 31. Dez. 2015 abgeschlossenes Jahr | Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr** |
| $ 0 | $ 96.613.734 | $ 129.446.346 |
| 105.890 | 45.658.229 | 62.704.629 |
| 0 | 208.379 | 293.984 |
| (49.179) | (48.901.201) | (91.287.969) |
| 0 | (632.862) | (821.321) |
| (7.147) | (6.309.894) | (3.721.935) |
| $ 49.564 | $ 86.636.385 | $ 96.613.734 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Capital Securities Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **Heta Asset Resolution AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2016 (a) | € | 8.450 | $ 6.242 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 13.06.2016 | CHF | 2.000 | 1.989 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 31.05.2016 (a) | | 36.860 | 24.487 | 0,40 |
| 4,250 % fällig am 31.10.2016 (a) | € | 7.500 | 5.540 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 24.01.2017 (a) (b) | | 6.900 | 5.097 | 0,09 |
| | | | 43.355 | 0,71 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 56.000 | 61.183 | 1,00 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **KBC Groep NV** | | 388.900 | 24.306 | 0,40 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| 5,625 % fällig am 29.03.2049 | € | 51.055 | 55.597 | 0,91 |
| | | | 141.086 | 2,31 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.10.2049 | $ | 17.535 | 8.592 | 0,14 |
| 9,000 % fällig am 29.06.2049 | | 46.776 | 30.872 | 0,51 |
| | | | 39.464 | 0,65 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **SMFG Preferred Capital GBP 2 Ltd.** | | | | |
| 10,231 % fällig am 29.07.2049 | £ | 7.385 | 16.307 | 0,27 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Danica Pension Livsforsikringsaktieselskab** | | | | |
| 4,375 % fällig am 29.09.2045 | € | 9.500 | 10.274 | 0,17 |
| **Danske Bank** | | | | |
| 5,875 % fällig am 29.10.2049 | | 61.786 | 68.209 | 1,11 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.06.2036 | | 27.110 | 29.534 | 0,48 |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | | 15.900 | 17.730 | 0,29 |
| | | | 125.747 | 2,05 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | 488.100 | 27.604 | 0,45 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas Cardif S.A.** | | | | |
| 4,032 % fällig am 29.11.2049 | € | 35.600 | 37.048 | 0,61 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,353 % fällig am 29.12.2049 | $ | 9.894 | 9.894 | 0,16 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | € | 42.100 | 46.992 | 0,77 |
| 7,195 % fällig am 29.06.2049 | $ | 600 | 687 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 76.115 | 78.208 | 1,28 |
| 7,781 % fällig am 29.06.2049 | € | 200 | 246 | 0,00 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | $ | 3.600 | 3.791 | 0,06 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.06.2047 | € | 27.400 | 28.986 | 0,47 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | | 2.000 | 2.069 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 31.10.2049 | | 9.800 | 10.235 | 0,17 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 (b) | | 87.714 | 98.142 | 1,60 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 26.141 | 37.975 | 0,62 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 100.044 | 102.616 | 1,68 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 8.000 | 8.849 | 0,15 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.01.2049 | € | 300 | 329 | 0,01 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | $ | 16.950 | 16.844 | 0,28 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 12.500 | $ 13.799 | 0,23 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 200 | 194 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | | 13.300 | 12.868 | 0,21 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | € | 9.600 | 10.425 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 10.462 | 11.697 | 0,19 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.04.2025 | $ | 8.000 | 7.564 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 24.11.2025 | | 9.700 | 9.404 | 0,15 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 60.300 | 60.228 | 0,98 |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | | 94.100 | 96.055 | 1,57 |
| 8,250 % fällig am 29.09.2049 | | 18.957 | 20.143 | 0,33 |
| | | | 725.288 | 11,85 |
| Summe Frankreich | | | 752.892 | 12,30 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | 761.500 | 18.485 | 0,30 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **HSH Nordbank AG** | | | | |
| 0,719 % fällig am 14.02.2017 | € | 1.000 | 989 | 0,02 |
| | | | 19.474 | 0,32 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Alpha Bank AE** | | 5.825.131 | 15.604 | 0,25 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | € | 600 | 609 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Eurobank Ergasias S.A.** | | 379.580 | 425 | 0,01 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 210.000 | 1.571 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 03.07.2017 | | 190.000 | 1.453 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 109.000 | 873 | 0,01 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 4.200 | 4.243 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 72.000 | 551 | 0,01 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 100 | 101 | 0,00 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **National Bank of GreeceS.A.** | | 19.522.490 | 7.214 | 0,12 |
| | | | 32.644 | 0,53 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 20.650 | 20.664 | 0,34 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2045 | | 5.000 | 4.950 | 0,08 |
| **Credit Suisse Group Guernsey I Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | | 90.415 | 93.314 | 1,52 |
| | | | 118.928 | 1,94 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Allied Irish Banks PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 26.11.2025 | € | 4.900 | 5.363 | 0,09 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Baggot Securities Ltd.** | | | | |
| 10,240 % fällig am 29.12.2049 | | 24.700.000 | 26.900 | 0,44 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 (b) | € | 23.300 | 26.514 | 0,43 |
| 10,000 % fällig am 30.07.2016 | | 70.450 | 79.743 | 1,30 |
| 10,000 % fällig am 12.02.2020 | | 2.950 | 4.010 | 0,07 |
| | | | 142.530 | 2,33 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | 8.464.600 | $ 28.099 | 0,46 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 47.900 | 47.207 | 0,77 |
| 6,625 % fällig am 08.05.2018 | € | 10.300 | 12.071 | 0,20 |
| 7,700 % fällig am 29.12.2049 (b) | $ | 27.600 | 28.165 | 0,46 |
| **Intesa Sanpaolo Vita SpA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 7.000 | 7.595 | 0,12 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 68.500 | 70.305 | 1,15 |
| | | | 193.442 | 3,16 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **HBOS Euro Finance Jersey LP** | | | | |
| 2,762 % fällig am 29.12.2049 | | 3.000 | 3.210 | 0,05 |
| **HSBC Capital Funding LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 301 | 0,01 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 9.100 | 9.025 | 0,15 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 10.600 | 10.610 | 0,17 |
| | | | 23.146 | 0,38 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.02.2024 | | 11.000 | 9.708 | 0,16 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | | 4.500 | 4.494 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 7.900 | 8.609 | 0,14 |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.09.2045 | | 16.450 | 18.028 | 0,30 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 74.671 | 77.051 | 1,26 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 78.740 | 84.817 | 1,39 |
| **Demeter Investments BV for Swiss Re Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2050 | | 8.600 | 8.607 | 0,14 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 57.600 | 56.556 | 0,92 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 14.03.2073 | £ | 400 | 610 | 0,01 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | € | 1.000 | 1.071 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 08.04.2044 | | 2.214 | 2.507 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland NV** | | | | |
| 4,650 % fällig am 04.06.2018 | $ | 3.100 | 3.202 | 0,05 |
| **SNS Bank NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.11.2025 | € | 16.460 | 17.823 | 0,29 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (b) | | 111.471.500 | 135.114 | 2,21 |
| | | | 418.489 | 6,84 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | $ | 18.330 | 17.543 | 0,29 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 (b) | € | 23.000 | 3.635 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | | 9.500 | 1.414 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 19.200 | 2.852 | 0,05 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 686 | 649 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 12.900 | 12.314 | 0,20 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 6.244 | 5.946 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 6.408 | 6.232 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 6.770 | 6.655 | 0,11 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 935 | 977 | 0,01 |
| | | | 40.674 | 0,66 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SPANIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 143.000 | $ | 152.256 | 2,49 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 9.800 | | 10.471 | 0,17 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 44.600 | | 47.904 | 0,78 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | € | 98.400 | | 100.752 | 1,65 |
| % fällig am 29.10.2049 | | 67.500 | | 79.924 | 1,31 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 159.800 | | 162.846 | 2,66 |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | | 55.300 | | 57.670 | 0,94 |
| | | | | 611.823 | 10,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 2.800 | | 3.218 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 200 | | 235 | 0,00 |
| | | | | 3.453 | 0,05 |
| Summe Spanien | | | | 615.276 | 10,05 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **Nordea Bank AB** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 20.000 | | 19.604 | 0,32 |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.11.2049 | | 9.400 | | 9.272 | 0,15 |
| | | | | 28.876 | 0,47 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | | 41.116 | | 44.397 | 0,73 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 102.275 | | 107.830 | 1,76 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 62.283 | | 63.062 | 1,03 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 47.283 | | 49.469 | 0,81 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 77.527 | | 88.497 | 1,45 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 60.000 | | 68.538 | 1,12 |
| 6,875 % fällig am 29.12.2049 | $ | 23.150 | | 22.956 | 0,37 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | | 14.580 | | 15.309 | 0,25 |
| | | | | 460.058 | 7,52 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | | |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | 6.249.300 | | 6.723 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 111.780 | | 127.499 | 2,08 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 41.373 | | 44.217 | 0,72 |
| 9,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 4.800 | | 8.438 | 0,14 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 31.032 | | 34.228 | 0,56 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 48.400 | | 71.479 | 1,17 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 103.741 | | 122.507 | 2,00 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 8.300 | | 8.865 | 0,15 |
| **Coventry Building Society** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 37.815 | | 54.015 | 0,88 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 1.000 | | 1.518 | 0,03 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 22.08.2033 | | 6.630 | | 10.931 | 0,18 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 129.200 | | 141.631 | 2,31 |
| **LBG Capital No.1 PLC** | | | | | |
| 2,975 % fällig am 12.03.2020 | | 12.992 | | 14.325 | 0,23 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 6.087 | | 9.472 | 0,15 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 19.715 | | 28.129 | 0,46 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.04.2049 | $ | 11.600 | $ | 12.383 | 0,20 |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 147.727 | | 228.589 | 3,74 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 46.333 | | 72.473 | 1,18 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | | |
| 2,019 % fällig am 29.10.2049 | € | 10.357 | | 10.791 | 0,18 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 11.03.2049 | £ | 17.190 | | 25.496 | 0,42 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 19.12.2023 | $ | 27.700 | | 29.881 | 0,49 |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | | 18.497 | | 21.503 | 0,35 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 40.700 | | 42.481 | 0,69 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 4.550 | | 4.823 | 0,08 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 18.137 | | 19.675 | 0,32 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 38.270 | | 30.664 | 0,50 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 (b) | £ | 100.400 | | 150.686 | 2,46 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 18.146 | | 22.758 | 0,37 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.07.2049 | | 29.500 | | 43.836 | 0,72 |
| | | | | 1.393.293 | 22,76 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 7,640 % fällig am 29.03.2049 | | 6.600.000 | | 6.930 | 0,11 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 10,250 % fällig am 29.06.2049 | | 661.575 | | 126.312 | 2,07 |
| | | | | 133.242 | 2,18 |
| Summe Großbritannien | | | | 1.533.258 | 25,05 |
| **USA** | | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | | |
| **Bank of America Corp.** | | 2.391.300 | | 40.246 | 0,66 |
| **Citigroup, Inc.** | | 812.600 | | 42.052 | 0,69 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | 710.600 | | 46.921 | 0,76 |
| | | | | 129.219 | 2,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | $ | 500 | | 501 | 0,01 |
| **American International Group, Inc.** | | | | | |
| 8,175 % fällig am 15.05.2058 | | 900 | | 1.186 | 0,02 |
| **Exeter Finance Corp.** | | | | | |
| 9,750 % fällig am 20.05.2019 | | 7.500 | | 7.367 | 0,12 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 9.425 | | 8.412 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | | 5.950 | | 5.258 | 0,09 |
| **MetLife Capital Trust X** | | | | | |
| 9,250 % fällig am 08.04.2038 | | 11.500 | | 15.899 | 0,26 |
| **Navient Corp.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.09.2017 | | 300 | | 296 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 11.100 | | 10.406 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 01.08.2033 | | 200 | | 135 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 25.10.2024 | | 8.800 | | 7.073 | 0,12 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 1.800 | | 1.805 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 1.350 | | 1.337 | 0,02 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 200 | | 211 | 0,00 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.06.2021 | | 1.900 | | 1.848 | 0,03 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 14.100 | | 15.208 | 0,25 |
| | | | | 76.942 | 1,26 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **American Express Co.** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 29.12.2049 | | 14.900.000 | $ | 14.174 | 0,23 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 6,100 % fällig am 29.12.2049 | | 19.700.000 | | 19.995 | 0,33 |
| 6,250 % fällig am 29.09.2049 | | 31.800.000 | | 31.919 | 0,52 |
| 6,500 % fällig am 29.10.2049 | | 5.000.000 | | 5.275 | 0,08 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | | |
| 4,950 % fällig am 29.12.2049 | | 24.600.000 | | 24.139 | 0,39 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 29.12.2049 | | 27.200.000 | | 26.214 | 0,43 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 18.400.000 | | 18.791 | 0,31 |
| **Citizens Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.12.2049 | | 10.000.000 | | 9.870 | 0,16 |
| **CoBank ACB** | | | | | |
| 6,200 % fällig | | 35.800 | | 3.616 | 0,06 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.12.2049 | | 63.700.000 | | 60.595 | 0,99 |
| 5,300 % fällig am 29.12.2049 | | 15.200.000 | | 15.181 | 0,25 |
| 6,100 % fällig am 29.10.2049 | | 44.800.000 | | 45.084 | 0,74 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 5.100.000 | | 5.164 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 29.01.2049 | | 5.000.000 | | 5.456 | 0,09 |
| **RBS Capital Funding Trust V** | | | | | |
| 5,900 % fällig | | 439.100 | | 10.846 | 0,18 |
| **RBS Capital Funding Trust VII** | | | | | |
| 6,080 % fällig | | 396.500 | | 9.925 | 0,16 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 5,900 % fällig am 29.12.2049 | | 42.200.000 | | 42.675 | 0,70 |
| | | | | 348.919 | 5,70 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | | |
| **BNP Paribas Securities Corp.** | | | | | |
| 0,450 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 bewertet mit USD 20.448. Besichert durch US Treasury Notes 0,337 % fällig am 31.07.2017 bewertet mit $13.878. Die Rückkauferlöse betragen $33.602.) | $ | 33.600 | | 33.600 | 0,55 |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.06.2044 bewertet mit $1.663. Die Rückkauferlöse betragen $1.600.) | | 1.600 | | 1.600 | 0,03 |
| **Credit Suisse Securities (USA) LLC** | | | | | |
| 0,550 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.08.2017 bewertet mit $1.839. Die Rückkauferlöse betragen $1.800.) | | 1.800 | | 1.800 | 0,03 |
| **Deutsche Bank Securities, Inc.** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.02.2043 bewertet mit $8.295. Die Rückkauferlöse betragen $8.100.) | | 8.100 | | 8.100 | 0,13 |
| **J.P. Morgan Securities LLC** | | | | | |
| 0,570 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,500 % fällig am 31.03.2017 bewertet mit $160.713. Besichert durch US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.12.2020 bewertet mit $45.841. Die Rückkauferlöse betragen $202.013.) | | 202.000 | | 202.000 | 3,30 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| TD Securities (USA) LLC | | | |
| 0,560 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044 bewertet mit $191.932. Besichert durch US Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.05.2044 bewertet mit $196.409. Besichert durch US Treasury Bond 3,750 % fällig am 15.11.2043 bewertet mit $86.470. Die Rückkauferlöse betragen $462.029.) | $ 462.000 | $ 462.000 | 7,55 |
| | | 709.100 | 11,59 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| US-SCHATZOBLIGATIONEN | | | |
| US Treasury Bills | | | |
| 0,231 % fällig am 07.01.2016 (c) | $ 3.737 | $ 3.737 | 0,06 |
| Summe USA | | 1.267.917 | 20,72 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente - Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 6.040.814** | **98,71** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 362 | $ 4 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 30 | (36) | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 152 | 512 | 0,01 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 712 | 166 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.467 | (575) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.623 | (490) | (0,01) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 324 | 327 | 0,01 |
| | | | | $ (92) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (92)** | **0,00** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 151.600 | $ 1.101 | 0,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ 1.101** | **0,02** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Navient Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | $ 700 | $ (40) | $ (11) | $ (29) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[3]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Sub Financials Series 22 Index | (1,000 %) | 20.12.2019 | BRC | € 49.800 | $ 669 | $ 1.590 | $ (921) | 0,01 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 22 Index | (1,000 %) | 20.12.2019 | CBK | 49.800 | 669 | 1.498 | (829) | 0,01 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 22 Index | (1,000 %) | 20.12.2019 | JPM | 49.800 | 669 | 1.529 | (860) | 0,01 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 23 Index | (1,000 %) | 20.06.2020 | BPS | 48.800 | 945 | 1.299 | (354) | 0,02 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | BPS | 25.500 | 730 | 726 | 4 | 0,01 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | CBK | 24.500 | 702 | 642 | 60 | 0,01 |
| | | | | | $ 4.384 | $ 7.284 | $ (2.900) | 0,07 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 30.393 | AUD | 41.822 | CBK | $ 34 | $ 0 | $ 34 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 41.822 | $ | 30.292 | UAG | 0 | (136) | (136) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 27.563 | | 26.846 | BOA | 0 | (690) | (690) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 28.417 | CHF | 28.067 | JPM | 0 | (378) | (378) | (0,01) |
| 01/2016 | CHF | 504 | $ | 496 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 5.639 | | 5.991 | BOA | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| 01/2016 | | 207 | | 225 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 83.508 | | 90.366 | CBK | 151 | (500) | (349) | (0,01) |
| 01/2016 | | 471.942 | | 501.418 | GLM | 216 | (11.469) | (11.253) | (0,18) |
| 01/2016 | | 4.976 | | 5.413 | HUS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 614.084 | € | 558.794 | HUS | 0 | (7.066) | (7.066) | (0,12) |
| 01/2016 | | 31.224 | | 28.499 | JPM | 6 | (272) | (266) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 5.825 | $ | 6.370 | JPM | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.156 | | 1.261 | RBC | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.849 | | 9.615 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.446.234 | | 1.537.157 | UAG | 27 | (33.914) | (33.887) | (0,55) |
| 01/2016 | $ | 1.570.654 | € | 1.437.933 | UAG | 0 | (8.628) | (8.628) | (0,14) |
| 01/2016 | | 5.146 | £ | 3.392 | BOA | 0 | (147) | (147) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 4 | $ | 7 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.425 | | 18.733 | BOA | 420 | 0 | 420 | 0,01 |
| 01/2016 | | 587.238 | | 883.841 | BPS | 18.311 | 0 | 18.311 | 0,30 |
| 01/2016 | $ | 4.903 | £ | 3.284 | BPS | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 445 | $ | 664 | DUB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | £ | 10 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 891.773 | | 602.193 | SCX | 0 | (4.201) | (4.201) | (0,07) |
| 01/2016 | | 1.375 | | 916 | UAG | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 9.677 | $ | 14.620 | UAG | 357 | 0 | 357 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 557.500 | | 4.564 | GLM | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.608 | JPY | 557.500 | MSB | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 7.350 | $ | 843 | BOA | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 41.822 | | 30.352 | CBK | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 28.067 | | 28.452 | JPM | 378 | 0 | 378 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 5.354 | | 5.855 | AZD | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.994 | € | 1.815 | BOA | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.600 | $ | 1.744 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | | 558.794 | | 614.519 | HUS | 7.071 | 0 | 7.071 | 0,11 |
| 02/2016 | | 599 | | 657 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.437.933 | | 1.571.761 | UAG | 8.628 | 0 | 8.628 | 0,14 |
| 02/2016 | $ | 6.423 | £ | 4.303 | BOA | 0 | (81) | (81) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.472 | | 2.337 | GLM | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 587.193 | $ | 869.097 | SCX | 3.566 | 0 | 3.566 | 0,06 |
| 02/2016 | $ | 581 | HKD | 4.505 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 557.500 | $ | 4.610 | MSB | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 988 | | 702 | SCX | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | $ 39.311 | $ (67.918) | $ (28.607) | (0,47) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (24.263)** | **(0,40)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 6.017.560** | **98,33** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 271 | $ 271 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 26.753 | 222 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7.508 | 7.508 | 0,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 264 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 5 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 82 | 82 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Citibank N.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.342 | $ | 2.342 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 3 | | 3 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 34 | | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 32 | | 23 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.256 | | 2.256 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2.629 | | 2.856 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 11.268 | | 94 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 53 | | 53 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **15.725** | **0,26** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **86.719** | **1,41** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **6.120.004** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 64.033 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.253 und Barmittel in Höhe von USD 24.130 als Sicherheiten für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(d) Barmittel in Höhe von USD 19.047 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(e) Barmittel in Höhe von USD 8.621 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 264.333 | $ 5.769.114 | $ 7.367 | $ 6.040.814 |
| Finanzderivate[3] | (92) | (23.162) | 0 | (23.254) |
| **Summen** | **$ 264.241** | **$ 5.745.952** | **$ 7.367** | **$ 6.017.560** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 398.399 | $ 4.107.851 | $ 7.500 | $ 4.513.750 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 12.100 | 0 | 12.100 |
| Finanzderivate[3] | (9.488) | 65.423 | 0 | 55.935 |
| **Summen** | **$ 388.911** | **$ 4.185.374** | **$ 7.500** | **$ 4.581.785** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(g) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class Z (AUD) Hedged die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 400 | $ | 287 | AZD | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 238 | AUD | 330 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 33 | $ | 24 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 408 | | 296 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 73 | AUD | 100 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 196 | | 272 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 108 | | 150 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 400 | $ | 290 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 144 | AUD | 200 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 131 | | 183 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 132 | $ | 96 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 207 | | 150 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 226 | AUD | 312 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 287 | | 400 | AZD | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 290 | | 400 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 290 | | 400 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 96 | | 132 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 149 | | 207 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 15 | $ (5) | $ 10 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Class E CHF (Hedged) und Class S CHF (Hedged) die folgenden Devisenkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 11.678 | CHF | 11.941 | BOA | $ 264 | $ (13) | $ 251 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 178 | $ | 174 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 56 | | 55 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12 | CHF | 12 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 1.472 | $ | 1.470 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 50 | CHF | 50 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 33.791 | $ | 34.184 | CBK | 427 | 0 | 427 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 31.456 | CHF | 32.116 | DUB | 628 | 0 | 628 | 0,01 |
| 01/2016 | | 14.842 | | 15.275 | FBF | 417 | 0 | 417 | 0,01 |
| 01/2016 | | 3.671 | | 3.753 | GLM | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| 01/2016 | | 32.485 | | 33.179 | JPM | 662 | 0 | 662 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 39.010 | $ | 39.496 | JPM | 525 | 0 | 525 | 0,01 |
| 01/2016 | | 23.692 | | 23.917 | MSB | 249 | 0 | 249 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.003 | CHF | 2.012 | MSB | 22 | (15) | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 108 | $ | 108 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 251 | CHF | 248 | SOG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 31.568 | | 32.058 | UAG | 457 | 0 | 457 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 33.809 | $ | 34.227 | UAG | 452 | 0 | 452 | 0,01 |
| 02/2016 | | 155 | | 157 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 34.211 | CHF | 33.776 | CBK | 0 | (427) | (427) | (0,01) |
| 02/2016 | | 39.545 | | 39.010 | JPM | 0 | (525) | (525) | (0,01) |
| 02/2016 | | 23.879 | | 23.625 | MSB | 0 | (248) | (248) | 0,00 |
| 02/2016 | | 34.266 | | 33.809 | UAG | 0 | (449) | (449) | (0,01) |
| | | | | | | $ 4.184 | $ (1.685) | $ 2.499 | 0,04 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 653.352 | $ | 717.903 | BOA | $ 8.167 | $ 0 | $ 8.167 | 0,13 |
| 01/2016 | $ | 682.942 | € | 640.558 | BOA | 12.896 | 0 | 12.896 | 0,21 |
| 01/2016 | | 18.188 | | 16.849 | BPS | 188 | (72) | 116 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 16.855 | $ | 18.309 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 48.680 | € | 45.031 | CBK | 288 | (51) | 237 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 12.383 | $ | 13.509 | CBK | 74 | (17) | 57 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.939 | € | 2.748 | DUB | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| 01/2016 | | 502.276 | | 474.034 | GLM | 12.667 | 0 | 12.667 | 0,21 |
| 01/2016 | € | 653.352 | $ | 717.997 | HUS | 8.261 | 0 | 8.261 | 0,13 |
| 01/2016 | $ | 680.466 | € | 638.531 | HUS | 13.170 | 0 | 13.170 | 0,22 |
| 01/2016 | € | 520.343 | $ | 568.614 | JPM | 3.365 | 0 | 3.365 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 2.104 | € | 1.978 | NAB | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.627 | | 1.491 | RBC | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 16.940 | $ | 18.402 | RBC | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.196 | € | 9.307 | SCX | 0 | (86) | (86) | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 6 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 704.447 | | 662.831 | UAG | 15.586 | 0 | 15.586 | 0,26 |
| 01/2016 | € | 654.900 | $ | 715.354 | UAG | 3.936 | 0 | 3.936 | 0,06 |
| 02/2016 | $ | 725.572 | € | 659.868 | BOA | 0 | (8.249) | (8.249) | (0,13) |
| 02/2016 | | 718.506 | | 653.352 | HUS | 0 | (8.267) | (8.267) | (0,14) |
| 02/2016 | | 569.003 | | 520.343 | JPM | 0 | (3.353) | (3.353) | (0,05) |
| 02/2016 | € | 6 | $ | 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 711.802 | € | 651.196 | UAG | 0 | (3.907) | (3.907) | (0,06) |
| | | | | | | $ 78.690 | $ (24.011) | $ 54.679 | 0,89 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 875 | £ 581 | AZD | $ 0 | $ (19) | $ (19) | 0,00 |
| 01/2016 | 350 | 233 | BOA | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 456 | $ 686 | BOA | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 60.386 | £ 40.125 | BPS | 0 | (1.247) | (1.247) | (0,02) |
| 01/2016 | £ 2.039 | $ 3.005 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 50.703 | 75.244 | CBK | 514 | 0 | 514 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 76.817 | £ 50.846 | CBK | 0 | (1.874) | (1.874) | (0,03) |
| 01/2016 | £ 98 | $ 147 | DUB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 74.347 | £ 49.318 | DUB | 0 | (1.657) | (1.657) | (0,03) |
| 01/2016 | £ 49.494 | $ 73.448 | JPM | 499 | 0 | 499 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 805 | £ 531 | JPM | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 01/2016 | 74.171 | 49.197 | MSB | 0 | (1.660) | (1.660) | (0,03) |
| 01/2016 | £ 49.494 | $ 73.275 | MSB | 326 | 0 | 326 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 87 | £ 59 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 42.187 | $ 62.435 | SCX | 256 | 0 | 256 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 437 | £ 288 | UAG | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | 73.240 | 49.350 | CBK | 0 | (497) | (497) | (0,01) |
| 02/2016 | 73.451 | 49.494 | JPM | 0 | (496) | (496) | (0,01) |
| 02/2016 | 73.280 | 49.494 | MSB | 0 | (325) | (325) | 0,00 |
| 02/2016 | 62.440 | 42.187 | SCX | 0 | (256) | (256) | 0,00 |
| 02/2016 | 129 | 87 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 1.611 | $ (8.075) | $ (6.464) | (0,10) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Administrative SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 554 | SEK 4.829 | BOA | $ 19 | $ 0 | $ 19 | 0,00 |
| 01/2016 | 553 | 4.838 | BPS | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK 177 | $ 21 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 649 | SEK 5.642 | CBK | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK 3.553 | $ 426 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | 5.066 | 606 | GLM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | 3.552 | 424 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.057 | 483 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 454 | SEK 3.963 | MSB | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | 427 | 3.553 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | 425 | 3.552 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | 424 | 3.552 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 91 | $ (10) | $ 81 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class und Class M Retail SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 1.051 | $ 741 | CBK | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 02/2016 | 395 | 279 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 179 | SGD 250 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | 538 | 759 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | 265 | 376 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 16.955 | 24.033 | DUB | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| 02/2016 | 18.560 | 26.181 | HUS | 0 | (137) | (137) | 0,00 |
| 02/2016 | 71 | 100 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 10.741 | 15.122 | SCX | 0 | (100) | (100) | 0,00 |
| | | | | $ 2 | $ (288) | $ (286) | 0,00 |

**(h) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 35.669 | $ 38.927 | $ (149) | $ 0 | $ (149) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(i) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 0,480 % | 05.11.2015 | 05.01.2016 | € 9.562 | $ (10.395) | (0,17) |
| BPS | 0,880 % | 05.11.2015 | 05.01.2016 | £ 8.526 | (27.342) | (0,45) |
| BRC | (0,500 %) | 30.11.2015 | 26.11.2017 | € 5.057 | (5.491) | (0,09) |
| CFR | (0,600 %) | 17.12.2015 | 16.12.2017 | $ 1.438 | (1.438) | (0,02) |
| CFR | (0,300 %) | 16.07.2015 | 15.07.2017 | € 3.673 | (3.985) | (0,06) |
| JML | (2,000 %) | 17.12.2015 | 16.12.2017 | 2.822 | (3.062) | (0,05) |
| JML | (0,650 %) | 18.12.2015 | 09.11.2017 | 3.388 | (3.680) | (0,06) |
| JML | (0,500 %) | 16.12.2015 | 14.12.2017 | 2.121 | (2.304) | (0,04) |
| | | | | | $ (57.697) | (0,94) |

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 16 | $ 0 | $ 16 |
| BOA | 12.407 | (15.910) | (3.503) |
| BPS | 18.812 | (13.820) | 4.992 |
| BRC | 664 | (713) | (49) |
| CBK | (555) | 330 | (225) |
| DUB | (1.014) | 1.990 | (3.004) |
| FBF | 417 | (470) | (53) |
| GLM | 1.253 | (2.820) | (1.567) |
| HUS | 13.040 | (16.930) | (3.890) |
| JPM | 1.108 | (1.700) | (592) |
| MSB | (1.642) | 1.320 | (322) |
| NAB | 45 | 0 | 45 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (809) | 640 | (169) |
| SOG | (4) | 0 | (4) |
| UAG | (17.630) | 22.733 | (5.103) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(k) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,71 | 100,25 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,00 | (0,21) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,02 | 0,00 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,40) | 1,45 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,27 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO Capital Securities Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31 DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAVFund (a) | | 228.748.729 | $ 2.288.935 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 145.000 | 162.052 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | | 116.600 | 159.508 |
| Santander UK Group Holdings PLC 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 100.400 | 157.982 |
| Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 99.183 | 157.775 |
| HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 129.200 | 144.850 |
| | | **AKTIEN** | |
| Intesa Sanpaolo SpA | | 39.052.100 | 130.997 |
| BNP Paribas S.A. | | 2.195.662 | 129.968 |
| | | **PARI (000S)** | |
| HSBC Holdings PLC 6,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 117.400 | 119.938 |
| Banco Popular Espanol S.A. 8,250 % fällig am 29.04.2049 | € | 100.200 | 111.636 |
| Credit Suisse Group AG 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 102.075 | 108.935 |
| | | **AKTIEN** | |
| JPMorgan Chase & Co. | | 1.548.500 | 96.220 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Societe Generale S.A. 8,000 % fällig am 29.09.2049 | $ | 94.100 | 94.940 |
| BNP Paribas S.A. 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 76.115 | 77.423 |
| Barclays PLC 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 48.400 | 75.525 |
| Lloyds Banking Group PLC 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 45.963 | 74.604 |
| Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 59.472 | 73.487 |
| UniCredit SpA 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 65.600 | 73.261 |
| Danske Bank 5,875 % fällig am 29.10.2049 | | 61.786 | 69.889 |
| UBS Group AG 5,750 % fällig am 29.12.2049 | | 60.000 | 68.430 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAVFund (a) | | 257.690.625 | $ 2.578.291 |
| BNP Paribas S.A. | | 2.707.762 | 156.269 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 116.600 | 154.096 |
| HSBC Holdings PLC 6,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 117.400 | 116.347 |
| | | **AKTIEN** | |
| Intesa Sanpaolo SpA | | 30.838.279 | 106.486 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Royal Bank of Scotland PLC 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 86.135 | 97.060 |
| Danske Bank 5,750 % fällig am 31.10.2049 | € | 73.807 | 83.721 |
| LBG Capital No.2 PLC 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 38.038 | 80.768 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 7,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 71.200 | 79.888 |
| HSBC Holdings PLC 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 68.525 | 76.934 |
| | | **AKTIEN** | |
| UniCredit SpA | | 11.444.000 | 73.291 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Portugal Obrigacoes do Tesouro OT 4,100 % fällig am 15.02.2045 | € | 53.600 | 68.691 |
| Virgin Media Investment Holdings Ltd. 3,500 % fällig am 07.06.2020 | $ | 66.100 | 66.106 |
| UBS AG 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 54.100 | 58.295 |
| | | **AKTIEN** | |
| Barclays PLC | | 14.158.400 | 56.273 |
| | | **PARI (000S)** | |
| HSBC Capital Funding LP 10,176 % fällig am 29.12.2049 | $ | 36.862 | 55.293 |
| | | **AKTIEN** | |
| ING Groep NV | | 4.012.500 | 55.230 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Bankia S.A. 4,000 % fällig am 22.05.2024 | € | 49.200 | 54.239 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 37.200 | 51.928 |
| | | **AKTIEN** | |
| JPMorgan Chase & Co. | | 837.900 | 51.644 |

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BERMUDA** | | | | |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.10.2025 | $ | 500 | $ 541 | 0,15 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 10.900 | 2.471 | 0,70 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 21.700 | 4.739 | 1,35 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2018 | | 9.200 | 1.718 | 0,49 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2019 | | 6.300 | 1.007 | 0,29 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2017 | | 4.300 | 1.037 | 0,30 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 944 | 191 | 0,05 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 70 | 13 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | $ | 200 | 198 | 0,06 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2018 | € | 400 | 356 | 0,10 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | $ | 100 | 92 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 200 | 178 | 0,05 |
| | | | 12.000 | 3,42 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **IPIC GMTN Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.11.2020 | | 600 | 664 | 0,19 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) | DKK | 2.814 | 421 | 0,12 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **France Government Bond (a)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (b) | € | 5.656 | 6.393 | 1,83 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 104 | 117 | 0,03 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (b) | | 2.390 | 2.732 | 0,78 |
| | | | 9.242 | 2,64 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 (a) (b) | | 5.933 | 6.787 | 1,94 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | | 100 | 101 | 0,03 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 400 | 400 | 0,11 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 ClassA Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | | 161 | 165 | 0,05 |
| | | | 565 | 0,16 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (a)** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | € | 7.551 | 8.656 | 2,47 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 586 | 709 | 0,20 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 3.019 | 3.788 | 1,08 |
| **Marche M5 Srl** | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | | 92 | 100 | 0,03 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 255 | 271 | 0,08 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 522 | 576 | 0,16 |
| | | | 14.100 | 4,02 |
| **JAPAN** | | | | |
| **Japan Government CPI-Linked Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 (a) | JPY | 210.611 | 1.851 | 0,53 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **Mexico Government International Bond (a)** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 | MXN | 21.682 | $ 1.275 | 0,36 |
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 | | 14.118 | 831 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 | | 35.264 | 2.249 | 0,64 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 | | 28.229 | 1.792 | 0,51 |
| | | | 6.147 | 1,75 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 136 | 147 | 0,04 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **New Zealand Government Bond (a)** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 8.460 | 5.867 | 1,67 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 | | 400 | 301 | 0,09 |
| | | | 6.168 | 1,76 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 3,200 % fällig am 03.04.2017 | $ | 1.600 | 1.631 | 0,46 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 500 | 501 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 300 | 304 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 900 | 938 | 0,27 |
| | | | 3.374 | 0,96 |
| **KATAR** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 20.01.2020 | | 300 | 332 | 0,10 |
| **Qatari Diar Finance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.07.2020 | | 800 | 885 | 0,25 |
| | | | 1.217 | 0,35 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 26.01.2020 | € | 7.050 | 8.804 | 2,51 |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 1.200 | 1.354 | 0,39 |
| | | | 10.158 | 2,90 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.04.2022 | $ | 200 | 225 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 29.06.2020 | | 200 | 221 | 0,06 |
| **Republik Korea** | | | | |
| 7,125 % fällig am 16.04.2019 | | 1.000 | 1.160 | 0,33 |
| | | | 1.606 | 0,46 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 3.000 | 3.194 | 0,91 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 1.400 | 1.434 | 0,41 |
| **BPE Financiaciones S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.02.2017 | | 1.000 | 1.105 | 0,32 |
| 2,875 % fällig am 19.05.2016 | | 900 | 986 | 0,28 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 100 | 112 | 0,03 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 (a) | | 3.180 | 3.397 | 0,97 |
| | | | 10.228 | 2,92 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | | 500 | 571 | 0,16 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 700 | 735 | 0,21 |
| | | | 1.306 | 0,37 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 08.04.2019 | | 200 | 232 | 0,07 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 2.500 | $ 3.692 | 1,06 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 100 | 106 | 0,03 |
| | | | 3.798 | 1,09 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.11.2019 | £ | 416 | 642 | 0,18 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 | | 1.070 | 1.674 | 0,48 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (b) | | 171 | 313 | 0,09 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 | | 181 | 335 | 0,10 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2058 | | 41 | 86 | 0,02 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 104 | 245 | 0,07 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 | | 209 | 507 | 0,14 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2017 (b) | | 24.112 | 37.166 | 10,61 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 140 | 733 | 0,21 |
| | | | 41.701 | 11,90 |
| Summe Großbritannien | | | 45.499 | 12,99 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 700 | 700 | 0,20 |
| 3,250 % fällig am 29.09.2017 | | 2.700 | 2.703 | 0,77 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 3.100 | 3.553 | 1,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | | 300 | 323 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2017 | | 1.200 | 1.284 | 0,37 |
| 6,000 % fällig am 01.09.2017 | | 500 | 532 | 0,15 |
| 7,625 % fällig am 01.06.2019 | | 2.400 | 2.782 | 0,79 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | | 800 | 810 | 0,23 |
| **Citicorp Lease Pass-Through Trust 1999-1** | | | | |
| 8,040 % fällig am 15.12.2019 | | 300 | 354 | 0,10 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 500 | 497 | 0,14 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.01.2018 | | 1.100 | 1.098 | 0,31 |
| 4,207 % fällig am 15.04.2016 | | 2.075 | 2.092 | 0,60 |
| **Fresenius Medical Care US Finance, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.07.2017 | | 1.100 | 1.180 | 0,34 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,283 % fällig am 30.01.2017 | € | 350 | 380 | 0,11 |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | $ | 1.600 | 1.605 | 0,46 |
| 6,250 % fällig am 01.09.2017 | | 1.700 | 1.821 | 0,52 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2019 | | 1.800 | 1.818 | 0,52 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 300 | 304 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 300 | 309 | 0,09 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 200 | 220 | 0,06 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 400 | 402 | 0,12 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.11.2021 | € | 200 | 224 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | $ | 2.400 | 2.567 | 0,73 |
| **Kinder Morgan Finance Co. LLC** | | | | |
| 5,700 % fällig am 05.01.2016 | | 2.500 | 2.500 | 0,71 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc. (c)** | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.01.2024 | | 100 | 7 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 | £ | 100 | 13 | 0,00 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 7,300 % fällig am 13.05.2019 | $ | 600 | 690 | 0,20 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.02.2018 | | 100 | 85 | 0,03 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 900 | 934 | 0,27 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.02.2016 | | 500 | 502 | 0,14 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,042 % fällig am 15.09.2016 | | 500 | 503 | 0,14 |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 | | 200 | 205 | 0,06 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,500 % fällig am 15.09.2016 | $ 274 | $ 276 | 0,08 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | 500 | 551 | 0,16 |
| | | 33.824 | 9,66 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (c) | 46 | 34 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (c) | 36 | 32 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 20.05.2046 (c) | 1.095 | 838 | 0,24 |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (c) | 27 | 20 | 0,01 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2035 | 247 | 206 | 0,06 |
| 0,632 % fällig am 25.07.2046 | 30 | 26 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2037 | 85 | 67 | 0,02 |
| 0,743 % fällig am 20.11.2035 | 30 | 25 | 0,01 |
| 1,257 % fällig am 25.12.2035 | 16 | 13 | 0,00 |
| 2,673 % fällig am 25.02.2037 (c) | 32 | 29 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.05.2046 (c) | 29 | 21 | 0,01 |
| 0,632 % fällig am 25.10.2046 | 35 | 23 | 0,01 |
| 0,957 % fällig am 25.02.2047 | 45 | 27 | 0,01 |
| 1,177 % fällig am 25.11.2046 | 47 | 24 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,154 % fällig am 25.09.2045 | 159 | 155 | 0,04 |
| 2,314 % fällig am 25.10.2034 | 18 | 18 | 0,00 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 0,921 % fällig am 25.10.2031 | 74 | 68 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 1,122 % fällig am 25.06.2034 | 43 | 41 | 0,01 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,414 % fällig am 10.09.2047 | 259 | 263 | 0,07 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,746 % fällig am 20.09.2034 | 85 | 84 | 0,02 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,635 % fällig am 25.02.2036 (c) | 16 | 14 | 0,00 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | |
| 9,867 % fällig am 24.12.2049 | 593 | 610 | 0,17 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | 874 | 806 | 0,23 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | 265 | 266 | 0,08 |
| 2,735 % fällig am 25.01.2035 | 168 | 164 | 0,05 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (c) | 33 | 30 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2034 | 44 | 43 | 0,01 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2034 | 306 | 296 | 0,08 |
| 3,226 % fällig am 25.11.2034 | 36 | 37 | 0,01 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 2,267 % fällig am 25.10.2033 | 112 | 105 | 0,03 |
| 2,741 % fällig am 25.11.2035 (c) | 21 | 16 | 0,00 |
| 2,956 % fällig am 25.08.2036 (c) | 30 | 22 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 25.12.2033 | 999 | 943 | 0,27 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 2,466 % fällig am 25.03.2037 (c) | 22 | 21 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2045 | 15 | 11 | 0,00 |
| 2,070 % fällig am 25.09.2035 | 19 | 18 | 0,01 |
| 2,430 % fällig am 25.09.2035 | 154 | 154 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,701 % fällig am 25.12.2031 (c) | 79 | 58 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | 270 | 231 | 0,07 |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | 231 | 194 | 0,06 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | 258 | 228 | 0,07 |
| 1,182 % fällig am 25.09.2034 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,718 % fällig am 25.09.2047 (c) | 29 | 27 | 0,01 |
| 2,790 % fällig am 25.06.2033 | 276 | 273 | 0,08 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.09.2031 | 31 | 31 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,723 % fällig am 25.08.2035 | 109 | 98 | 0,03 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.08.2037 | 193 | 99 | 0,03 |
| 0,812 % fällig am 25.02.2036 | 200 | 174 | 0,05 |
| **First Republic Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,681 % fällig am 15.11.2031 | 7 | 7 | 0,00 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,931 % fällig am 25.06.2034 | 19 | 18 | 0,00 |
| **GreenPoint MTA Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2045 | $ 243 | $ 215 | 0,06 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,311 % fällig am 25.06.2034 | 59 | 58 | 0,02 |
| 2,806 % fällig am 25.09.2035 | 16 | 16 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | 267 | 224 | 0,06 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | |
| 0,472 % fällig am 25.10.2036 | 2 | 1 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 25.10.2033 | 74 | 71 | 0,02 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,771 % fällig am 15.12.2030 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Mid-State Capital Corporation Trust** | | | |
| 5,787 % fällig am 15.10.2040 | 208 | 224 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc.Trust** | | | |
| 0,472 % fällig am 25.07.2036 | 7 | 3 | 0,00 |
| 0,482 % fällig am 25.05.2037 | 83 | 53 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.01.2047 (c) | 1 | 1 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative LoanTrust** | | | |
| 2,716 % fällig am 25.10.2035 | 234 | 220 | 0,06 |
| **Regal Trust IV** | | | |
| 2,151 % fällig am 29.09.2031 | 145 | 134 | 0,04 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.11.2034 | 274 | 236 | 0,07 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | |
| 7,500 % fällig am 25.06.2035 (c) | 421 | 444 | 0,13 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.06.2046 | 77 | 33 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 21 | 22 | 0,01 |
| **RiverView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2047 | 710 | 669 | 0,19 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 0,552 % fällig am 25.05.2037 (c) | 17 | 12 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 1,102 % fällig am 19.10.2026 | 21 | 21 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 20.04.2035 | 190 | 198 | 0,06 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,632 % fällig am 25.04.2036 | 23 | 16 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | 17 | 13 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2045 | 15 | 13 | 0,00 |
| 0,982 % fällig am 19.07.2034 | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,062 % fällig am 19.10.2034 | 41 | 40 | 0,01 |
| 1,102 % fällig am 19.03.2034 | 34 | 34 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,427 % fällig am 25.07.2032 | 19 | 18 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | 3.165 | 2.939 | 0,84 |
| 0,732 % fällig am 25.01.2045 | 62 | 59 | 0,02 |
| 0,812 % fällig am 25.10.2044 | 681 | 663 | 0,19 |
| 1,257 % fällig am 25.08.2046 | 30 | 25 | 0,01 |
| 1,657 % fällig am 25.06.2042 | 5 | 5 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.03.2035 | 179 | 183 | 0,05 |
| 2,738 % fällig am 25.12.2034 | 19 | 19 | 0,01 |
| 2,853 % fällig am 25.12.2034 | 289 | 285 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (c) | 245 | 245 | 0,07 |
| | | 14.438 | 4,12 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Alameda, California, Bay Area Toll Authority Toll Bridge Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,918 % fällig am 01.04.2040 | 600 | 793 | 0,23 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,734 % fällig am 15.02.2033 | 200 | 268 | 0,08 |
| **Los Angeles, California, Department of Water & Power Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 5,516 % fällig am 01.07.2027 | 500 | 575 | 0,16 |
| **New York, New York State Urban Development Corporation Income Tax Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 5,770 % fällig am 15.03.2039 | $ 100 | $ 120 | 0,03 |
| **New York, New York, Metropolitan Transportation Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,814 % fällig am 15.11.2040 | 200 | 265 | 0,08 |
| **New York, New York, Transitional Finance Authority, Future Tax Secured Bonds, Series 2010** | | | |
| 5,508 % fällig am 01.08.2037 | 200 | 244 | 0,07 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2009** | | | |
| 7,300 % fällig am 01.10.2039 | 500 | 700 | 0,20 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2034 | 100 | 140 | 0,04 |
| 7,550 % fällig am 01.04.2039 | 200 | 291 | 0,08 |
| | | 3.396 | 0,97 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | |
| **BNP Paribas Securities Corp.** | | | |
| 0,450 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Treasury Inflation-Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2016 bewertet mit $10.931. Die Rückkauferlöse betragen $10.701.) | 10.700 | 10.700 | 3,05 |
| **Citigroup Global Markets, Inc.** | | | |
| 0,580 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024 bewertet mit $11.338. Die Rückkauferlöse betragen $11.101.) | 11.100 | 11.100 | 3,17 |
| **Deutsche Bank Securities, Inc.** | | | |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bond 3,125 % fällig am 15.02.2043 bewertet mit $8.295. Die Rückkauferlöse betragen $8.100.) | 8.100 | 8.100 | 2,31 |
| | | 29.900 | 8,53 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,397 % fällig am 27.10.2037 | 3.592 | 3.574 | 1,02 |
| 0,992 % fällig am 25.09.2036 | 24 | 24 | 0,01 |
| 5,401 % fällig am 01.11.2034 | 1.056 | 1.240 | 0,35 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2044 | 12 | 14 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2028 | 26 | 29 | 0,01 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 6.000 | 5.991 | 1,71 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,781 % fällig am 15.12.2031 | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,831 % fällig am 15.04.2028 | 24 | 24 | 0,01 |
| 0,931 % fällig am 15.03.2024 | 19 | 19 | 0,01 |
| 0,981 % fällig am 15.03.2032 | 240 | 243 | 0,07 |
| 2,526 % fällig am 01.01.2034 | 7 | 8 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2035 - 01.08.2035 | 1.368 | 1.491 | 0,43 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 13 | 15 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,652 % fällig am 20.02.2035 | 107 | 108 | 0,03 |
| 0,782 % fällig am 20.03.2060 | 73 | 73 | 0,02 |
| 0,892 % fällig am 20.02.2038 | 66 | 67 | 0,02 |
| 1,061 % fällig am 20.08.2062 | 2.486 | 2.515 | 0,72 |
| 1,214 % fällig am 20.07.2062 | 1.978 | 1.992 | 0,57 |
| 6,000 % fällig am 16.12.2029 | 204 | 227 | 0,06 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 5,902 % fällig am 10.02.2018 | 46 | 48 | 0,01 |
| | | 17.705 | 5,05 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2016 - 15.07.2024 (b) (d) (e) | 180.697 | 179.610 | 51,27 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 100 | 96 | 0,03 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 - 15.07.2025 | 12.377 | 12.061 | 3,44 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 12.436 | 12.309 | 3,51 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 - 15.02.2045 | $ 3.912 | $ 3.431 | 0,98 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 1.133 | 1.155 | 0,33 |
| 1,625 % fällig am 15.01.2018 | 454 | 469 | 0,13 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 1.249 | 1.366 | 0,39 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2016 (e) | 1.318 | 1.318 | 0,38 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 434 | 516 | 0,15 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 - 15.01.2027 | 27.281 | 29.751 | 8,49 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 | 21.776 | 22.989 | 6,56 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 | 44 | 58 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 87 | 118 | 0,03 |
| | | 265.247 | 75,71 |
| Summe USA | | 364.510 | 104,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (†)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 10.603 | $ 106 | 0,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 496.970** | **141,84** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 10 | $ (16) | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 87 | (26) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 121 | (49) | (0,01) |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 107 | 298 | 0,08 |
| | | | | $ 207 | 0,06 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 371 | $ 44 | $ 27 | 0,01 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,875 | 11.03.2016 | 101 | 15 | 23 | 0,00 |
| | | | | $ 59 | $ 50 | 0,01 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 101 | $ (8) | $ (1) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | 98,000 | 21.12.2016 | 371 | (9) | (5) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 101 | (4) | (7) | 0,00 |
| | | | | $ (21) | $ (13) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 244** | **0,07** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 1.700 | $ 2 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 29.200 | $ (59) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 17.700 | 195 | 0,06 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 14.900 | 185 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,225 % | 16.09.2025 | 1.300 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 2.300 | (22) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 % | 16.09.2025 | 7.400 | (93) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 8.200 | (151) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 19.100 | 33 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 18.900 | 63 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 16.12.2035 | 900 | (55) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | $ 6.250 | $ (84) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,570 % | 10.02.2046 | 600 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 800 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | € 300 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 6.300 | 12 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 5.400 | (161) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 18.12.2017 | JPY 2.580.000 | 18 | 0,01 |
| | | | | | $ (119) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (117)** | **(0,03)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-MonthUSD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | $ 6.500 | $ 47 | $ 29 | 0,01 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 24.700 | 16 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 23.800 | 19 | 2 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 24.600 | 23 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 23.06.2016 | 28.900 | 53 | 65 | 0,02 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 24.06.2016 | 28.600 | 51 | 65 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,683 % | 11.12.2017 | 2.000 | 280 | 200 | 0,05 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | 64.300 | 55 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 544 | $ 363 | 0,10 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 700 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 700 | (2) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 700 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (5) | $ (1) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 700 | $ (29) | $ (34) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,700 | 14.01.2016 | 1.600 | (27) | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (56) | $ (36) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-MonthUSD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 6.500 | $ (52) | $ (41) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 19.01.2016 | 6.300 | (25) | (2) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 % | 19.01.2016 | 6.300 | (23) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 20.500 | (66) | (31) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 13.400 | (50) | (20) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 11.12.2017 | 8.400 | (280) | (144) | (0,04) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 3.400 | (13) | (5) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | RYL | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 5.600 | (20) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (529) | $ (248) | (0,07) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| Cap - OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial)-(1+3,000 %)*20,0,000 %] | 22.06.2035 | € 1.400 | $ (64) | $ (36) | (0,01) |
| Cap - OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 %-(Referenzindex final/anfängliche Referenindex-1)-3,000 %] | 01.06.2016 | $ 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (65) | $ (36) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | $ 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | $ 3.700 | $ (42) | $ (49) | (0,01) |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | 238,643 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 02.10.2020 | 2.000 | (37) | (31) | (0,01) |
| | | | | | | $ (79) | $ (80) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AutoZone, Inc. | (1,000 %) | 20.06.2016 | BOA | $ 2.400 | $ (12) | $ (29) | $ 17 | (0,01) |
| Credit Agricole S.A. | (1,000 %) | 20.12.2016 | CBK | € 900 | (8) | 88 | (96) | 0,00 |
| Credit Agricole S.A. | (1,000 %) | 20.12.2016 | GST | 500 | (4) | 51 | (55) | 0,00 |
| L Brands, Inc. | (1,000 %) | 20.09.2017 | DUB | $ 800 | (7) | 42 | (49) | 0,00 |
| Viacom, Inc. | (1,340 %) | 20.06.2016 | DUB | 500 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| | | | | | $ (34) | $ 152 | $ (186) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finmeccanica SpA | 5,000 % | 20.03.2019 | FBF | € 300 | $ 40 | $ 47 | $ (7) | 0,01 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | $ 200 | 0 | (15) | 15 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 2.200 | (6) | (165) | 159 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 200 | (1) | (15) | 14 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 100 | 0 | (8) | 8 | 0,00 |
| Japan Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 100 | 0 | 1 | (1) | 0,00 |
| Lloyds Bank PLC | 3,000 % | 20.09.2017 | BOA | € 1.500 | 81 | 12 | 69 | 0,02 |
| Lloyds Bank PLC | 3,000 % | 20.09.2017 | DUB | 1.200 | 65 | 13 | 52 | 0,02 |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.03.2016 | BRC | $ 1.000 | 2 | 1 | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 550 | (1) | (4) | 3 | 0,00 |
| | | | | | $ 180 | $ (133) | $ 313 | 0,05 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,421 % | 04.01.2021 | HUS | BRL 1.900 | $ (37) | $ 0 | $ (37) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,500 % | 04.01.2021 | DUB | 900 | (11) | 0 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,500 % | 04.01.2021 | HUS | 1.400 | (17) | 0 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 1.400 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | GLM | 2.800 | 5 | (2) | 7 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,270 % | 15.08.2016 | BRC | € 18.700 | (39) | 0 | (39) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,305 % | 15.09.2016 | CBK | 6.300 | (14) | 1 | (15) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,290 % | 15.08.2017 | CBK | 6.700 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,625 % | 15.09.2018 | BRC | 1.500 | (2) | 1 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.09.2018 | GLM | 400 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised SeriesNSA | 0,650 % | 15.10.2018 | GLM | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 1.420 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,190 % | 15.04.2030 | CBK | 700 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | BRC | 900 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | JPM | 3.000 | 154 | (2) | 156 | 0,04 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | DUB | 600 | 15 | 2 | 13 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,358 % | 15.04.2035 | GLM | 300 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,550 % | 11.12.2044 | FBF | 1.300 | 155 | 3 | 152 | 0,04 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Commodity Real Return Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,530 % | 15.12.2044 | FBF | £ 200 | $ 21 | $ 2 | $ 19 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,010 % | 16.10.2017 | BOA | $ 1.600 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,620 % | 07.04.2018 | DUB | 25.000 | (84) | 0 | (84) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 26.08.2025 | BOA | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 234 | $ 4 | $ 230 | 0,07 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF ROHSTOFFE

| Zahlung/ Erhalt Referenzeinheit | Referenzeinheit | (Zahlung)/Erhalt fester Kurs je Einheit | Fälligkeits-datum | Kontrahent | Anzahl der Einheiten | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | BOA | 293.391 | $ 585 | $ 0 | $ 585 | 0,17 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | BPS | 263.681 | 526 | 0 | 526 | 0,15 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | CBK | 548.679 | 1.104 | 0 | 1.104 | 0,31 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | GLM | 223.896 | 486 | (27) | 513 | 0,14 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | JPM | 486.940 | 1.492 | 23 | 1.469 | 0,43 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total ReturnIndex | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | SOG | 57.845 | 115 | 0 | 115 | 0,03 |
| | | | | | | $ 4.308 | $ (4) | $ 4.312 | 1,23 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 965 | BRL | 3.848 | BOA | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 3.848 | $ | 981 | BOA | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 576 | BRL | 2.251 | BPS | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.251 | $ | 570 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.074 | | 1.220 | CBK | 190 | 0 | 190 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 1.043 | BRL | 4.074 | CBK | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.464 | | 13.084 | DUB | 0 | (157) | (157) | (0,04) |
| 01/2016 | BRL | 13.084 | $ | 3.345 | DUB | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 437 | BRL | 1.706 | FBF | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.706 | $ | 439 | FBF | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | | 63 | | 17 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 16 | BRL | 63 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 36 | | 141 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 141 | $ | 36 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.263 | | 1.100 | JPM | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.092 | BRL | 4.263 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 17 | | 64 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 64 | $ | 16 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.833 | | 982 | TOR | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 984 | BRL | 3.833 | TOR | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 5.407 | $ | 835 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 5 | | 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 42.533 | € | 38.709 | BOA | 0 | (484) | (484) | (0,14) |
| 01/2016 | € | 1.635 | $ | 1.775 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14.408 | € | 13.600 | CBK | 366 | 0 | 366 | 0,10 |
| 01/2016 | € | 1.777 | $ | 1.885 | DUB | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| 01/2016 | | 1.227 | | 1.308 | GLM | 0 | (25) | (25) | (0,01) |
| 01/2016 | | 48.119 | | 51.279 | HUS | 0 | (992) | (992) | (0,28) |
| 01/2016 | $ | 2.037 | € | 1.856 | JPM | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 446 | $ | 486 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.412 | | 1.550 | UAG | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 31.599 | | 47.632 | DUB | 1.059 | 0 | 1.059 | 0,30 |
| 01/2016 | $ | 38.149 | £ | 25.360 | JPM | 0 | (771) | (771) | (0,22) |
| 01/2016 | £ | 139 | $ | 208 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.444 | £ | 6.378 | UAG | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2.594 | INR | 172.269 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 59.120 | $ | 890 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 342.800 | | 2.806 | GLM | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 2.833 | JPY | 342.800 | MSB | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 16.247 | $ | 14 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.021.232 | | 1.738 | FBF | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| 01/2016 | | 952.812 | | 821 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 9.970 | | 6.516 | SCX | 0 | (309) | (309) | (0,09) |
| 01/2016 | TRY | 314 | | 109 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 530 | | 372 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 3.848 | | 955 | BOA | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.721 | BRL | 6.812 | DUB | 0 | (17) | (17) | (0,01) |
| 02/2016 | DKK | 3.035 | $ | 438 | UAG | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 38.709 | | 42.563 | BOA | 484 | 0 | 484 | 0,14 |
| 02/2016 | | 749 | | 823 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | £ | 6.136 | $ | 9.079 | UAG | $ 35 | $ 0 | $ 35 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 2.242 | JPY | 275.900 | JPM | 53 | 0 | 53 | 0,02 |
| 02/2016 | JPY | 12.296 | $ | 100 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 342.800 | | 2.835 | MSB | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | | 212.600 | | 1.732 | SCX | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| 02/2016 | NZD | 9.970 | | 6.818 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 577 | NZD | 885 | JPM | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| 02/2016 | SGD | 3.329 | $ | 2.365 | SCX | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| 02/2016 | TWD | 78.446 | | 2.417 | BPS | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 126 | MXN | 2.168 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 111.658 | $ | 6.405 | NGF | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| 04/2016 | BRL | 19.552 | | 6.110 | JPM | 1.318 | 0 | 1.318 | 0,38 |
| 04/2016 | $ | 1.200 | CNY | 7.116 | DUB | 0 | (128) | (128) | (0,04) |
| 04/2016 | CNY | 31.450 | $ | 4.891 | JPM | 151 | 0 | 151 | 0,04 |
| 04/2016 | $ | 4.100 | CNY | 24.334 | JPM | 0 | (433) | (433) | (0,12) |
| 09/2016 | CNH | 5.932 | $ | 900 | SCX | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| 10/2016 | BRL | 3.200 | | 812 | BOA | 74 | 0 | 74 | 0,02 |
| 10/2016 | | 1.700 | | 410 | BPS | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 10/2016 | | 1.300 | | 315 | CBK | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 10/2016 | | 4.700 | | 1.169 | JPM | 85 | 0 | 85 | 0,02 |
| 10/2016 | CNH | 7.976 | | 1.233 | SCX | 54 | 0 | 54 | 0,02 |
| 01/2017 | BRL | 3.600 | | 829 | BPS | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| 01/2017 | | 4.400 | | 1.017 | DUB | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| 01/2017 | | 7.300 | | 1.708 | GLM | 68 | 0 | 68 | 0,02 |
| 01/2017 | | 6.400 | | 1.506 | JPM | 68 | 0 | 68 | 0,02 |
| 01/2017 | | 4.300 | | 983 | TOR | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | | | | | | $ 4.420 | $ (3.637) | $ 783 | 0,22 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 5.433** | **1,55** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (i)** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | $ | (500) | $ (528) | (0,15) |
| 6,000 % fällig am 01.01.2046 | | (3.000) | (3.390) | (0,97) |
| | | | $ (3.918) | (1,12) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (3.918)** | **(1,12)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 498.612** | **142,31** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | $ 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 129 | 190 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 22 | 22 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 45 | 31 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 6.688 | 56 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 617 | 617 | 0,18 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 66 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7 | 7 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 2 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 192 | 192 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 185 | 185 | 0,05 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 48 | 34 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 19 | 21 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 41 | 60 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2.817 | 23 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 1.447** | **0,41** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (149.699)** | **(42,72)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 350.360** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 134.121 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

(c) Das Wertpapier ist in Verzug.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 9.390 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.990 und Barmittel von USD 683 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(f) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.260 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.

(h) Barmittel in Höhe von USD 482 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.

(i) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(j) Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 106 | $ 496.195 | $ 669 | $ 496.970 |
| Finanzderivate[3] | 244 | 5.316 | 0 | 5.560 |
| Leerverkäufe | 0 | (3.918) | 0 | (3.918) |
| **Summen** | **$ 350** | **$ 497.593** | **$ 669** | **$ 498.612** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 15.299 | $ 363.593 | $ 1.608 | $ 380.500 |
| Finanzderivate[3] | (168) | (13.849) | 0 | (14.017) |
| Leerverkäufe | 0 | (49.673) | 0 | (49.673) |
| **Summen** | **$ 15.131** | **$ 300.071** | **$ 1.608** | **$ 316.810** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

(k) Abgesicherte Devisenterminkontrakte

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 16.828 | $ 18.491 | BOA | $ 210 | $ 0 | $ 210 | 0,06 |
| 01/2016 | $ 18.396 | € 17.254 | BOA | 347 | 0 | 347 | 0,10 |
| 01/2016 | € 11 | $ 12 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.517 | 1.648 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.928 | 5.277 | CBK | 7 | (83) | (76) | (0,02) |
| 01/2016 | $ 894 | € 822 | CBK | 4 | (5) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 3 | 3 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 16.509 | 15.581 | GLM | 416 | 0 | 416 | 0,12 |
| 01/2016 | € 16.828 | $ 18.493 | HUS | 213 | 0 | 213 | 0,06 |
| 01/2016 | $ 18.120 | € 17.003 | HUS | 351 | 0 | 351 | 0,10 |
| 01/2016 | € 13.993 | $ 15.291 | JPM | 90 | 0 | 90 | 0,02 |
| 01/2016 | 296 | 315 | NAB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 486 | € 446 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 85 | 77 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 19.344 | 18.205 | UAG | 432 | 0 | 432 | 0,12 |
| 01/2016 | € 16.496 | $ 18.019 | UAG | 100 | 0 | 100 | 0,03 |
| 02/2016 | $ 19.307 | € 17.559 | BOA | 0 | (219) | (219) | (0,06) |
| 02/2016 | 18.507 | 16.828 | HUS | 0 | (213) | (213) | (0,06) |
| 02/2016 | 15.302 | 13.993 | JPM | 0 | (90) | (90) | (0,03) |
| 02/2016 | $ 17.964 | € 16.435 | UAG | 0 | (99) | (99) | (0,03) |
| | | | | $ 2.170 | $ (719) | $ 1.451 | 0,41 |

**(l) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutionell EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 1.570 | $ 1.713 | $ (7) | $ 0 | $ (7) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(m) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,450 % | 05.11.2015 | 07.04.2016 | $ 11.476 | $ (11.484) | (3,28) |
| BOS | 0,600 % | 23.11.2015 | 22.01.2016 | 55.244 | (55.280) | (15,78) |
| BSN | 0,340 % | 13.10.2015 | 13.01.2016 | 2.835 | (2.837) | (0,81) |
| BSN | 0,500 % | 10.11.2015 | 12.01.2016 | 6.495 | (6.499) | (1,85) |
| GRE | 0,580 % | 16.11.2015 | 15.01.2016 | 3.139 | (3.141) | (0,90) |
| GRE | 0,950 % | 10.12.2015 | 14.01.2016 | 2.613 | (2.614) | (0,74) |
| | | | | | $ (81.855) | (23,36) |

**(n) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | (0,183 %) | 30.11.2015 | 06.01.2016 | € 6.434 | $ (6.989) | (1,99) |
| MYI | (0,162 %) | 30.11.2015 | 06.01.2016 | 7.118 | (7.730) | (2,21) |
| MYI | 0,799 % | 30.11.2015 | 06.01.2016 | £ 25.370 | (37.426) | (10,68) |
| TDM | 1,266 % | 17.12.2015 | 14.01.2016 | $ 9.370 | (9.375) | (2,68) |
| | | | | | $ (61.520) | (17,56) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(o) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.079 | $ (900) | $ 179 |
| BPS | 602 | (380) | 222 |
| CBK | 1.598 | (1.070) | 528 |
| DUB | 752 | (1.320) | (568) |
| FBF | 191 | (270) | (79) |
| GLM | 828 | (990) | (162) |
| GST | (10) | 0 | (10) |
| HUS | (695) | 990 | 295 |
| JPM | 2.067 | (1.750) | 317 |
| MYC | 186 | (60) | 126 |
| NAB | (7) | 0 | (7) |
| NGF | (31) | 0 | (31) |
| RYL | (3) | 0 | (3) |
| SCX | (248) | 270 | 22 |
| SOG | 115 | 0 | 115 |
| TOR | 15 | 0 | 15 |
| UAG | 438 | (410) | 28 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(p) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 141,84 | 127,51 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,07 | (0,06) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,03) | (0,46) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,55 | (4,17) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (1,12) | (16,65) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Commodity Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2016 (b) | $ | 122.884 | $124.161 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | | 58.395 | 59.565 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2017 (b) | | 51.868 | 52.780 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 41.380 | 41.658 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | |
| 1,250 % fällig am 22.11.2017 (b) | | £25.094 | 40.314 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | $31.821 | 32.049 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 3.018.291 | 30.205 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | $26.197 | 25.873 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 17.587 | 21.752 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2015 | | $17.800 | 17.797 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 (b) | | 16.595 | 17.304 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 18.670 | 16.850 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 (b) | € | 13.588 | 16.508 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 13.289 | 15.835 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 15.200 | 15.321 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 8.416 | 13.960 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | € | 11.885 | 13.828 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b) | $ | 12.476 | 12.501 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 (b) | | 11.825 | 12.155 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 11.880 | 11.861 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | | 11.639 | 10.772 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 (b) | € | 8.163 | 10.379 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | $ | 10.300 | 10.256 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 10.349 | 9.945 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | 9.500 | 9.431 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2016 (b) | | $113.008 | $112.930 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 0,500 % fällig am 30.11.2016 | | 66.500 | 66.526 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 4.536.670 | 45.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,992 % fällig am 20.01.2060 | | $36.663 | 37.038 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 32.058 | 32.046 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 16.998 | 21.245 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | $21.420 | 20.923 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 31.07.2019 | | 19.650 | 19.939 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2015 | | 17.800 | 17.797 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 14.270 | 17.739 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | $18.670 | 16.970 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 15.200 | 15.397 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,150 % fällig am 12.11.2017 | € | 12.109 | 13.884 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 7.337 | 12.105 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | $11.880 | 11.832 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 (b) | € | 8.173 | 10.528 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | $10.300 | 10.321 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 (b) | € | 7.842 | 9.397 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | $9.500 | 9.325 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | | 9.387 | 8.738 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2015 | | 8.700 | 8.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 17.07.2015 | | 8.700 | 8.698 |
| **France Government Bond** | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 | € | 7.396 | 8.524 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | |
| 0,550 % fällig am 30.11.2019 (b) | | 7.312 | 8.428 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | $8.100 | 8.209 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 10.06.2015 | | 7.900 | 7.899 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2016 (b) | | 7.786 | 7.804 |

(a) Der Commodity Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 29.06.2049 | $ | 1.633 | $ 1.078 | 0,11 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 87.760 | 17.713 | 1,77 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 10 | 2 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | $ | 400 | 305 | 0,03 |
| | | | 19.098 | 1,91 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **QGOG Constellation S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 09.11.2019 | | 2.650 | 1.199 | 0,12 |
| **KANADA** | | | | |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | | 1.950 | 1.511 | 0,15 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.08.2020 | | 1.619 | 1.557 | 0,15 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 9.183 | 8.871 | 0,89 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 300 | 284 | 0,03 |
| | | | 12.223 | 1,22 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | | 4.025 | 3.504 | 0,35 |
| **MCE Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | | 6.000 | 5.490 | 0,55 |
| | | | 8.994 | 0,90 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Numericable Group S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.01.2023 | | 2.450 | 2.362 | 0,24 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **HONGKONG** | | | | |
| **Melco Crown EntertainmentLtd.** | | 33.216 | 558 | 0,06 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **IRLAND** | | | | |
| **Endo Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2023 | $ | 7.134 | 7.134 | 0,71 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 4.000 | 402 | 0,04 |
| | | | 7.536 | 0,75 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Berica 8 Residential MBS Srl** | | | | |
| 0,229 % fällig am 31.03.2048 | € | 17 | 19 | 0,00 |
| **Berica ABS Srl** | | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | | 1.025 | 1.103 | 0,11 |
| | | | 1.122 | 0,11 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | | 2.400 | 2.210 | 0,22 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 7.375 | 7.524 | 0,75 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | $ | 1.900 | 1.643 | 0,17 |
| **ConvaTec Finance International S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.01.2019 (b) | | 2.775 | 2.591 | 0,26 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.08.2022 | | 5.800 | 5.597 | 0,56 |
| | | | 19.565 | 1,96 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **MACAU** | | | | |
| **Wynn Macau Ltd.** | | 608.400 | $ 707 | 0,07 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Amaya Holdings BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2021 | $ | 303 | 284 | 0,03 |
| **Lunet RMBS BV** | | | | |
| 0,369 % fällig am 26.12.2045 | € | 1.227 | 1.333 | 0,13 |
| | | | 1.617 | 0,16 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **AABS Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.01.2038 | $ | 492 | 487 | 0,05 |
| **TIG FINCO PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 02.03.2020 | £ | 87 | 132 | 0,01 |
| 8,750 % fällig am 02.04.2020 | | 446 | 585 | 0,06 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.02.2022 | $ | 1.200 | 1.093 | 0,11 |
| | | | 2.297 | 0,23 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.02.2021 | | 4.949 | 4.935 | 0,49 |
| **Springleaf Funding Trust** | | | | |
| 3,920 % fällig am 16.01.2023 | | 3.300 | 3.300 | 0,33 |
| | | | 8.235 | 0,82 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **AWAS Leasing 2011-I Ltd.** | | | | |
| 4,870 % fällig am 02.10.2021 (h) | | 4.278 | 4.393 | 0,44 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | | 13.006 | 12.983 | 1,30 |
| **Gardner Denver, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.07.2020 | | 4.704 | 4.251 | 0,42 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 1.395 | 1.394 | 0,14 |
| **Texas Competitive Electric Holdings Co. LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.11.2016 | | 5.418 | 5.391 | 0,54 |
| | | | 28.412 | 2,84 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **CBS Corp.** | | 26.199 | 1.235 | 0,12 |
| **Capital One Financial Corp. (c)** | | 3.850 | 278 | 0,03 |
| **Citigroup, Inc.** | | 5.950 | 308 | 0,03 |
| **Walt Disney Co. (c)** | | 6.344 | 667 | 0,07 |
| **Hilton Worldwide Holdings,Inc.** | | 40.451 | 866 | 0,09 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | 5.153 | 340 | 0,03 |
| **MGM Resorts International** | | 84.725 | 1.925 | 0,19 |
| **Macy's, Inc.** | | 43.286 | 1.514 | 0,15 |
| **Pfizer, Inc.** | | 40.451 | 1.306 | 0,13 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | 26.799 | 1.339 | 0,13 |
| **Wynn Resorts Ltd.** | | 11.004 | 761 | 0,08 |
| | | | 10.539 | 1,05 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aviation Loan Trust** | | | | |
| 2,622 % fällig am 15.09.2021 | $ | 1.745 | 1.617 | 0,16 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.10.2019 (b) | | 1.125 | 702 | 0,07 |
| **Caesars Entertainment Operating Co., Inc. (d)** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2020 | | 1.800 | 1.377 | 0,14 |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 | | 8.336 | 6.377 | 0,64 |
| 11,250 % fällig am 01.06.2017 | | 9.700 | 7.323 | 0,73 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 1.011 | 365 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 167 | 53 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | $ | 1.425 | $ 438 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 6.977 | 3.689 | 0,37 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 6.900 | 7.585 | 0,76 |
| **CPG Merger Sub LLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.10.2021 | | 12.760 | 12.569 | 1,26 |
| **Crimson Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 8.400 | 5.775 | 0,58 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | | 3.650 | 3.267 | 0,33 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2026 | | 4.875 | 4.108 | 0,41 |
| **Exeter Finance Corp.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 20.05.2019 | | 8.000 | 7.858 | 0,79 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.08.2022 | | 4.025 | 3.441 | 0,34 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.11.2020 | | 3.100 | 2.790 | 0,28 |
| **Illinois Power Generating Co.** | | | | |
| 6,300 % fällig am 01.04.2020 | | 3.375 | 2.042 | 0,20 |
| 7,000 % fällig am 15.04.2018 | | 3.600 | 2.430 | 0,24 |
| 7,950 % fällig am 01.06.2032 | | 1.000 | 585 | 0,06 |
| **Intrepid Aviation Group Holdings LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2019 | | 4.276 | 3.528 | 0,35 |
| **iStar, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.11.2017 | | 4.975 | 4.890 | 0,49 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2022 | | 3.650 | 3.084 | 0,31 |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 6.235 | 5.565 | 0,56 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | | 1.425 | 1.259 | 0,13 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2033 | | 100 | 68 | 0,01 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 1.500 | 1.440 | 0,14 |
| **PHH Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | | 13.025 | 11.918 | 1,19 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.10.2025 | | 2.450 | 2.143 | 0,21 |
| **Ply Gem Industries, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2022 | | 21.914 | 20.084 | 2,01 |
| **SiTV LLC** | | | | |
| 10,375 % fällig am 01.07.2019 | | 550 | 443 | 0,04 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.12.2019 | | 1.175 | 1.119 | 0,11 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | | 2.600 | 1.820 | 0,18 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 11.742 | 11.683 | 1,17 |
| **Terraform Global Operating LLC** | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | | 5.000 | 4.013 | 0,40 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.10.2020 | | 3.200 | 3.104 | 0,31 |
| **Vander Intermediate Holding II Corp.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.02.2019 (b) | | 2.525 | 1.654 | 0,17 |
| **Westmoreland Coal Co.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.01.2022 | | 2.600 | 1.612 | 0,16 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 6.305 | 5.643 | 0,57 |
| | | | 159.461 | 15,96 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,700 % fällig am 25.09.2035 | | 1.000 | 842 | 0,08 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.07.2036 | | 1.286 | 899 | 0,09 |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | | 1.000 | 859 | 0,09 |
| 0,972 % fällig am 25.12.2045 (d) | | 500 | 313 | 0,03 |
| 1,397 % fällig am 25.11.2033 | | 388 | 365 | 0,04 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,666 % fällig am 25.02.2036 (d) | | 1.677 | 1.428 | 0,14 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | | 3.637 | 3.575 | 0,36 |
| 0,592 % fällig am 20.09.2046 | | 51 | 45 | 0,00 |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (d) | | 4.063 | 3.030 | 0,30 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (d) | | 22 | 19 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (d) | | 5.778 | 4.241 | 0,42 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 1,657 % fällig am 25.08.2035 | $ 55 | $ 50 | 0,01 |
| 1,722 % fällig am 25.10.2035 (d) | 42 | 34 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (d) | 5.644 | 5.177 | 0,52 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (d) | 876 | 764 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (d) | 802 | 714 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (d) | 7.242 | 5.890 | 0,59 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (d) | 39 | 37 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (d) | 4.111 | 3.283 | 0,33 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (d) | 396 | 376 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 (d) | 2.967 | 2.074 | 0,21 |
| 18,641 % fällig am 25.07.2035 | 541 | 724 | 0,07 |
| 26,714 % fällig am 25.09.2037 | 739 | 1.192 | 0,12 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,042 % fällig am 25.05.2035 | 600 | 494 | 0,05 |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | 1.000 | 899 | 0,09 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 1.024 | 403 | 0,04 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2036 | 349 | 137 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | 853 | 342 | 0,03 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | 5.120 | 3.966 | 0,40 |
| 0,802 % fällig am 25.02.2036 | 1.867 | 1.275 | 0,13 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 0,552 % fällig am 25.01.2037 | 5.148 | 3.511 | 0,35 |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | 1.463 | 1.212 | 0,12 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust (d)** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.01.2037 | 1.994 | 1.262 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | 765 | 655 | 0,07 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 20.10.2036 | 2.025 | 1.587 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (d) | 621 | 441 | 0,04 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,815 % fällig am 25.09.2034 | 891 | 876 | 0,09 |
| **BCAP LLC** | | | |
| 10,860 % fällig am 26.07.2036 | 428 | 436 | 0,04 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,632 % fällig am 25.04.2037 | 717 | 626 | 0,06 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2047 (d) | 877 | 673 | 0,07 |
| 2,280 % fällig am 26.07.2036 | 331 | 331 | 0,03 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust (d)** | | | |
| 2,749 % fällig am 25.07.2036 | 308 | 262 | 0,03 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 | 402 | 363 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.02.2037 | 212 | 201 | 0,02 |
| 0,622 % fällig am 25.04.2037 (d) | 2.331 | 2.305 | 0,23 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2047 | 1.856 | 1.597 | 0,16 |
| 0,862 % fällig am 25.12.2035 (d) | 2.200 | 1.675 | 0,17 |
| 1,072 % fällig am 25.08.2035 | 972 | 925 | 0,09 |
| 1,102 % fällig am 25.10.2035 | 100 | 83 | 0,01 |
| 1,672 % fällig am 25.08.2037 | 1.912 | 1.758 | 0,18 |
| 4,718 % fällig am 25.06.2047 (d) | 686 | 615 | 0,06 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.09.2046 | 27 | 23 | 0,00 |
| 0,972 % fällig am 25.06.2036 | 600 | 526 | 0,05 |
| 2,297 % fällig am 25.07.2034 | 749 | 734 | 0,07 |
| **Blackstone CQP Holdco LP** | | | |
| 2,324 % fällig am 19.03.2019 | 9.647 | 9.622 | 0,96 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | 6.900 | 4.169 | 0,42 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,042 % fällig am 25.09.2034 | 736 | 670 | 0,07 |
| **ChaseFlex Trust** | | | |
| 0,752 % fällig am 25.08.2037 (d) | 9.417 | 6.500 | 0,65 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,391 % fällig am 25.10.2046 | 1.613 | 1.604 | 0,16 |
| 0,582 % fällig am 25.12.2036 | 3.414 | 2.262 | 0,23 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2036 | 2.200 | 1.693 | 0,17 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2037 | 3.652 | 2.851 | 0,29 |
| 4,584 % fällig am 25.10.2037 | 3.085 | 2.863 | 0,29 |
| 5,050 % fällig am 25.09.2037 (d) | 245 | 223 | 0,02 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (d) | 119 | 106 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.05.2035 | 9.073 | 7.609 | 0,76 |
| 0,562 % fällig am 25.07.2037 (d) | 47 | 41 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.06.2047 (d) | 4.274 | 3.314 | 0,33 |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | 5.469 | 4.986 | 0,50 |
| 0,592 % fällig am 25.03.2037 | 3.231 | 3.350 | 0,34 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | 4.078 | 3.805 | 0,38 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2047 | 1.332 | 1.221 | 0,12 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2047 | 2.911 | 2.686 | 0,27 |
| 0,662 % fällig am 25.03.2036 | 2.861 | 2.599 | 0,26 |
| 0,712 % fällig am 25.06.2036 | 625 | 561 | 0,06 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2036 (d) | 1.022 | 969 | 0,10 |
| 0,942 % fällig am 25.12.2035 | 2.762 | 2.734 | 0,27 |
| 1,002 % fällig am 25.04.2035 | 1.638 | 1.631 | 0,16 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 2.085 | 1.992 | 0,20 |
| 5,049 % fällig am 25.10.2046 (d) | 298 | 283 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2037 | 1.298 | 1.254 | 0,13 |
| 0,682 % fällig am 25.09.2046 | 4.300 | 2.861 | 0,29 |
| 0,922 % fällig am 25.08.2047 | 184 | 182 | 0,02 |
| 1,022 % fällig am 25.07.2035 | 2.000 | 1.948 | 0,20 |
| 1,062 % fällig am 25.10.2035 | 1.900 | 1.660 | 0,17 |
| 1,172 % fällig am 25.11.2035 | 5.200 | 3.620 | 0,36 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust (d)** | | | |
| 2,435 % fällig am 20.05.2036 | 5.173 | 4.629 | 0,46 |
| 2,634 % fällig am 25.09.2037 | 734 | 645 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 | 28 | 26 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | 3.959 | 3.807 | 0,38 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 1,572 % fällig am 25.09.2034 (d) | 1.003 | 860 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 | 627 | 551 | 0,06 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 2,838 % fällig am 29.12.2037 | 1.216 | 721 | 0,07 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 347 | 266 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 (d) | 397 | 338 | 0,03 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.11.2036 | 2.706 | 1.509 | 0,15 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.07.2047 | 43 | 35 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.10.2036 (d) | 320 | 180 | 0,02 |
| 0,612 % fällig am 25.08.2047 | 2.040 | 1.643 | 0,16 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Alternate Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | 8.115 | 5.800 | 0,58 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,874 % fällig am 25.08.2035 (d) | 51 | 40 | 0,00 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 28.05.2037 | 720 | 714 | 0,07 |
| **First Frankin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,912 % fällig am 25.07.2035 | 275 | 239 | 0,02 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.04.2036 | 1.756 | 1.482 | 0,15 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2036 | 2.100 | 1.796 | 0,18 |
| 0,912 % fällig am 25.09.2035 | 1.345 | 1.316 | 0,13 |
| 1,847 % fällig am 25.10.2034 | 909 | 767 | 0,08 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (d)** | | | |
| 2,207 % fällig am 25.08.2035 | 28 | 24 | 0,00 |
| 2,299 % fällig am 25.04.2036 | 1.888 | 1.598 | 0,16 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (d) | 134 | 119 | 0,01 |
| **Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates** | | | |
| 5,992 % fällig am 25.11.2055 | 698 | 408 | 0,04 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 0,752 % fällig am 25.01.2036 | 2.092 | 1.718 | 0,17 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 0,512 % fällig am 25.01.2037 | 674 | 407 | 0,04 |
| 0,542 % fällig am 25.12.2036 | 824 | 455 | 0,05 |
| 0,562 % fällig am 25.06.2036 | 2.903 | 2.491 | 0,25 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2046 | 352 | 318 | 0,03 |
| 0,652 % fällig am 25.12.2046 | 1.125 | 634 | 0,06 |
| 1,157 % fällig am 25.09.2035 (d) | 3.683 | 3.281 | 0,33 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | |
| 0,391 % fällig am 26.08.2033 | 7.000 | 5.894 | 0,59 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 0,832 % fällig am 25.04.2036 | 1.000 | 828 | 0,08 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 25.03.2036 | 2.834 | 1.960 | 0,20 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | 3.109 | 1.330 | 0,13 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | 1.241 | 882 | 0,09 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | 10.929 | 9.437 | 0,94 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | 2.006 | 1.659 | 0,17 |
| 0,672 % fällig am 25.02.2037 | 50 | 32 | 0,00 |
| 2,389 % fällig am 25.06.2037 | 2.468 | 1.396 | 0,14 |
| 2,578 % fällig am 25.07.2037 | 3.778 | 2.586 | 0,26 |
| 2,832 % fällig am 25.12.2034 | 860 | 788 | 0,08 |
| 2,950 % fällig am 25.05.2037 (d) | 250 | 192 | 0,02 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,732 % fällig am 27.06.2037 | 4.553 | 3.743 | 0,37 |
| 3,192 % fällig am 25.11.2036 (d) | 221 | 199 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.03.2047 | 100 | 72 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2037 | 1.300 | 961 | 0,10 |
| 5,059 % fällig am 25.11.2036 | 1.500 | 1.518 | 0,15 |
| **JPMorgan Mortgage Trust (d)** | | | |
| 2,690 % fällig am 25.10.2036 | 2.258 | 1.922 | 0,19 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 | 431 | 328 | 0,03 |
| **Lavender Trust** | | | |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036 | 1.568 | 1.171 | 0,12 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,512 % fällig am 25.06.2037 | 3.496 | 2.170 | 0,22 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 (d) | 442 | 425 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 0,381 % fällig am 25.03.2047 (d) | 1.035 | 842 | 0,08 |
| 0,602 % fällig am 25.07.2037 (d) | 897 | 632 | 0,06 |
| 1,121 % fällig am 25.08.2047 | 742 | 506 | 0,05 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.03.2046 | 6.243 | 3.921 | 0,39 |
| 0,682 % fällig am 25.08.2045 | 3.973 | 3.112 | 0,31 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,552 % fällig am 25.10.2036 | 2.472 | 1.415 | 0,14 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | 756 | 370 | 0,04 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2037 | 105 | 52 | 0,01 |
| 0,532 % fällig am 25.08.2037 | 1.557 | 942 | 0,09 |
| **Morgan Stanley ABS Capital I, Inc. Trust** | | | |
| 0,802 % fällig am 25.12.2035 | 12.000 | 10.169 | 1,02 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 6.146 | 4.074 | 0,41 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 2.472 | 1.146 | 0,11 |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | 1.700 | 1.020 | 0,10 |
| 0,602 % fällig am 25.03.2037 | 2.889 | 1.492 | 0,15 |
| 0,652 % fällig am 25.09.2036 | 93 | 52 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 25.02.2037 | 15.332 | 7.184 | 0,72 |
| 1,187 % fällig am 25.07.2035 | 350 | 334 | 0,03 |
| 1,337 % fällig am 25.03.2035 | 4.600 | 4.000 | 0,40 |
| 1,672 % fällig am 25.07.2037 | 1.500 | 1.031 | 0,10 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | |
| 0,712 % fällig am 25.01.2036 | 193 | 175 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.04.2037 | 103 | 58 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.04.2037 | 8.859 | 5.140 | 0,51 |
| 1,472 % fällig am 25.12.2034 | 1.500 | 1.302 | 0,13 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,146 % fällig am 25.11.2037 | 592 | 456 | 0,05 |
| 5,965 % fällig am 25.09.2046 (d) | 1.145 | 752 | 0,08 |
| **National City Mortgage Capital Trust** | | | |
| 2,861 % fällig am 25.03.2038 | 1.115 | 1.049 | 0,11 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,742 % fällig am 25.04.2037 | 2.100 | 1.510 | 0,15 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.10.2035 | 375 | 375 | 0,04 |
| 3,422 % fällig am 25.01.2033 (d) | 196 | 174 | 0,02 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 0,371 % fällig am 25.06.2036 | 1.144 | 846 | 0,08 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 1.407 | 748 | 0,07 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | 888 | 514 | 0,05 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | 3.639 | 2.132 | 0,21 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | 841 | 493 | 0,05 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.10.2036 (d) | 4.735 | 3.726 | 0,37 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | $ 2.300 | $ 2.072 | 0,21 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-ThroughCertificates** | | | |
| 1,667 % fällig am 25.01.2036 | 1.500 | 1.358 | 0,14 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 0,992 % fällig am 25.03.2037 | 1.600 | 1.384 | 0,14 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037 | 2.410 | 1.300 | 0,13 |
| 5,893 % fällig am 25.06.2037 (d) | 1.304 | 668 | 0,07 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 (d) | 2.623 | 1.585 | 0,16 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.07.2036 (d) | 413 | 324 | 0,03 |
| 0,772 % fällig am 25.08.2035 (d) | 79 | 59 | 0,01 |
| 1,172 % fällig am 25.11.2036 (d) | 1.815 | 1.211 | 0,12 |
| 3,069 % fällig am 25.07.2035 | 12 | 11 | 0,00 |
| 3,613 % fällig am 25.09.2035 (d) | 8 | 7 | 0,00 |
| 3,652 % fällig am 25.12.2035 (d) | 59 | 51 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2034 | 4.777 | 5.034 | 0,50 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (d) | 1.140 | 965 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2036 (d) | 3.461 | 2.891 | 0,29 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 (d) | 224 | 193 | 0,02 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | 2.169 | 2.006 | 0,20 |
| 0,582 % fällig am 25.07.2036 | 633 | 613 | 0,06 |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 (d) | 6.392 | 5.509 | 0,55 |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | 833 | 735 | 0,07 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 | 3.000 | 2.769 | 0,28 |
| 0,692 % fällig am 25.05.2037 | 1.300 | 1.194 | 0,12 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | 1.400 | 1.206 | 0,12 |
| 1,302 % fällig am 25.08.2034 | 1.084 | 885 | 0,09 |
| 1,517 % fällig am 25.03.2035 | 1.450 | 1.194 | 0,12 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,451 % fällig am 25.12.2035 | 2.284 | 1.666 | 0,17 |
| 0,582 % fällig am 25.12.2036 | 1.056 | 1.021 | 0,10 |
| 0,612 % fällig am 25.02.2036 | 838 | 821 | 0,08 |
| 0,722 % fällig am 25.05.2036 (d) | 1.537 | 1.157 | 0,12 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | 500 | 448 | 0,04 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 (d) | 4.897 | 4.288 | 0,43 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 (d) | 385 | 263 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | 566 | 433 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 (d) | 692 | 490 | 0,05 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (d) | 208 | 187 | 0,02 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 1,397 % fällig am 26.12.2034 | $ 792 | $ 614 | 0,06 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 1,382 % fällig am 25.01.2036 (d) | 574 | 477 | 0,05 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.06.2036 | 2.057 | 1.913 | 0,19 |
| 0,602 % fällig am 25.07.2037 | 475 | 303 | 0,03 |
| 1,372 % fällig am 25.10.2037 | 3.007 | 2.096 | 0,21 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2037 | 891 | 525 | 0,05 |
| 0,812 % fällig am 25.12.2036 | 2.000 | 1.659 | 0,17 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2037 (d) | 3.247 | 1.678 | 0,17 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,662 % fällig am 25.05.2037 (d) | 292 | 217 | 0,02 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 32 | 26 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2046 | 8.682 | 6.938 | 0,69 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2036 | 1.373 | 1.149 | 0,12 |
| 0,632 % fällig am 25.09.2047 (d) | 14.852 | 10.307 | 1,03 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2036 | 2.254 | 1.695 | 0,17 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage LoanTrust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | 445 | 395 | 0,04 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2047 | 6.800 | 5.295 | 0,53 |
| 0,762 % fällig am 25.02.2036 | 500 | 452 | 0,05 |
| 0,922 % fällig am 25.11.2037 | 4.500 | 2.896 | 0,29 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 (d) | 995 | 889 | 0,09 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (d)** | | | |
| 0,872 % fällig am 25.05.2035 | 4.427 | 3.505 | 0,35 |
| 1,007 % fällig am 25.02.2047 | 4.993 | 3.616 | 0,36 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust (d)** | | | |
| 0,962 % fällig am 25.03.2037 | 6.638 | 4.857 | 0,49 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037 | 36 | 33 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,052 % fällig am 25.11.2035 | 1.100 | 994 | 0,10 |
| | | 391.985 | 39,23 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Erie, New York, Tobacco Asset Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2028 | 300 | 300 | 0,03 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 5,422 % fällig am 25.07.2025 | $ 4.600 | $ 4.577 | 0,46 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,195 % fällig am 10.02.2016 | 5.500 | 5.498 | 0,55 |
| 0,230 % fällig am 27.01.2016 | 2.300 | 2.300 | 0,23 |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | 3.800 | 3.799 | 0,38 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 7,972 % fällig am 25.12.2027 | 2.500 | 2.339 | 0,23 |
| | | 18.513 | 1,85 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,200 % fällig am 14.01.2016 (e) | 812 | 812 | 0,08 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | 21.540 | 20.925 | 2,09 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 (f) | 1.750 | 1.789 | 0,18 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 0,375 % fällig am 31.01.2016 (g) | 1.102 | 1.102 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 31.05.2020 | 58.000 | 57.505 | 5,76 |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 - 31.07.2020 (f) (g) | 78.800 | 78.462 | 7,85 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | 25.000 | 24.379 | 2,44 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | 8.675 | 8.656 | 0,87 |
| | | 193.630 | 19,38 |
| Summe USA | | 811.075 | 81,16 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 10.023.243 | 100.252 | 10,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 988.605** | **98,92** |

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 2.055 | $ (766) | (0,08) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 324 | (215) | (0,02) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2018 | 219 | (234) | (0,02) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 269 | (141) | (0,02) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 718 | (505) | (0,05) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2018 | 132 | (140) | (0,01) |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 754 | 54 | 0,00 |
| Euro STOXX 50March Futures | Short | 03/2016 | 280 | 382 | 0,04 |
| JPX-Nikkei 400 Index March Futures | Long | 03/2016 | 647 | (119) | (0,01) |
| S & P 500 E-mini Index March Futures | Short | 03/2016 | 322 | 34 | 0,00 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 85 | (24) | 0,00 |
| | | | | $ (1.674) | (0,17) |

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | |
| Call - Euro STOXX 50 Index | € 3.700,000 | 20.12.2019 | 102 | $ 401 | $ 252 | 0,03 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | |
| Put - Euro STOXX 50 Index | € 2.400,000 | 20.12.2019 | 102 | $ (326) | $ (302) | (0,03) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.724)** | **(0,17)** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | $ 25.600 | $ (57) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2019 | 118.200 | (1.014) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,910 % | 20.08.2019 | 126.300 | (1.017) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 % | 19.08.2025 | 11.400 | (235) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,335 % | 24.08.2025 | 6.300 | (130) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 100.500 | 337 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 3,000 % | 11.09.2024 | £ 2.200 | (120) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 18.700 | (178) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,150 % | 16.03.2046 | 150 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,175 % | 16.03.2046 | 1.650 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 6-MonthGBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 1.500 | (9) | 0,00 |
| Erhalt | 6-MonthJPY-LIBOR | 1,000 % | 18.09.2023 | JPY 1.600 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 07.07.2021 | MXN 72.300 | (34) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,840 % | 14.09.2021 | 61.800 | 15 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,810 % | 29.09.2021 | 31.000 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,750 % | 30.09.2021 | 35.900 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 11.10.2021 | 125.200 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | NZD 24.300 | 1.201 | 0,12 |
| | | | | | $ (1.235) | (0,12) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.235)** | **(0,12)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 6,700 | 29.09.2016 | $ 3.600 | $ 81 | $ 102 | 0,01 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | | |
| Call - Euro STOXX 50 Index | JPM | € 3.600,000 | 20.12.2019 | 3.704 | $ 1.355 | $ 1.023 | 0,10 |
| Call - Euro STOXX 50 Index | DUB | 3.631,000 | 20.12.2019 | 7.834 | 2.739 | 2.091 | 0,21 |
| | | | | | $ 4.094 | $ 3.114 | 0,31 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | $ 23.950 | $ (34) | $ (36) | (0,01) |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 1,000 % | 20.01.2016 | 29.450 | (46) | (14) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BPS | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 5.500 | (10) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BPS | Verkauf | 1,000 % | 20.01.2016 | 2.450 | (4) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 28.400 | (50) | (24) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 20.01.2016 | 45.250 | (72) | (22) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 87.150 | (151) | (140) | (0,02) |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 3.300 | (7) | (3) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | JPM | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 7.600 | (4) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 7.600 | (15) | (12) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 16.03.2016 | 14.000 | (38) | (24) | 0,00 |
| | | | | | | $ (431) | $ (280) | (0,03) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 7,000 | 29.09.2016 | $ 3.600 | $ (56) | $ (53) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 7,000 | 07.12.2016 | 10.030 | (141) | (186) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH 7,000 | 07.12.2016 | $ 9.980 | $ (140) | $ (185) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | GLM | 7,050 | 08.12.2016 | 6.940 | (97) | (118) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,050 | 08.12.2016 | 18.510 | (261) | (315) | (0,03) |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | 6,280 | 29.09.2016 | 3.600 | (22) | (8) | 0,00 |
| | | | | | $ (717) | $ (865) | (0,09) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ZINSSWAPOPTIONEN | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-MonthUSD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 28.03.2016 | $ 14.300 | $ (61) | $ (14) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OPTIONEN AUF INDIZES | | | | | | | |
| Put - Euro STOXX 50 Index | JPM | € 2.300,000 | 20.12.2019 | 3.704 | $ (1.253) | $ (968) | (0,10) |
| Put - Euro STOXX 50 Index | DUB | 2.300,000 | 20.12.2019 | 7.834 | (2.739) | (2.048) | (0,20) |
| | | | | | $ (3.992) | $ (3.016) | (0,30) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Avnet, Inc. | (1,000 %) | 20.12.2018 | MYC | $ 8.500 | $ (185) | $ 106 | $ (291) | (0,02) |
| Barrick Gold Corp. | (1,000 %) | 20.09.2020 | FBF | 1.500 | 150 | 128 | 22 | 0,02 |
| Barrick Gold Corp. | (1,000 %) | 20.09.2020 | JPM | 1.900 | 190 | 177 | 13 | 0,02 |
| CA, Inc. | (1,000 %) | 20.12.2018 | FBF | 12.400 | (222) | (103) | (119) | (0,02) |
| Canadian Natural Resources Ltd. | (1,000 %) | 20.09.2020 | MYC | 4.700 | 392 | 182 | 210 | 0,04 |
| ConocoPhillips | (1,000 %) | 20.06.2019 | GST | 3.150 | 30 | (127) | 157 | 0,00 |
| ConocoPhillips | (1,000 %) | 20.06.2019 | MYC | 20.500 | 198 | (418) | 616 | 0,02 |
| ConocoPhillips | (1,000 %) | 20.09.2020 | MYC | 11.500 | 380 | (200) | 580 | 0,04 |
| Darden Restaurants, Inc. | (1,000 %) | 20.06.2021 | JPM | 5.300 | 3 | 75 | (72) | 0,00 |
| Dow Chemical Co. | (1,000 %) | 20.12.2020 | GST | 6.775 | (73) | (66) | (7) | (0,01) |
| Dow Chemical Co. | (1,000 %) | 20.12.2020 | MYC | 6.775 | (73) | (72) | (1) | (0,01) |
| Ei Du Pont de Nemours & Co. | (1,000 %) | 20.12.2020 | MYC | 4.400 | (78) | (70) | (8) | (0,01) |
| Halliburton Co. | (1,000 %) | 20.09.2020 | FBF | 4.200 | (24) | (73) | 49 | 0,00 |
| Halliburton Co. | (1,000 %) | 20.09.2020 | GST | 1.000 | (6) | (15) | 9 | 0,00 |
| Newmont Mining Corp. | (1,000 %) | 20.09.2020 | CBK | 6.600 | 343 | 386 | (43) | 0,03 |
| Newmont Mining Corp. | (1,000 %) | 20.09.2020 | GST | 1.350 | 70 | 73 | (3) | 0,01 |
| NXP BV | (5,000 %) | 20.06.2021 | BPS | € 4.650 | (801) | (802) | 1 | (0,08) |
| Vodafone Group PLC | (1,000 %) | 20.06.2021 | GST | 4.750 | 4 | (5) | 9 | 0,00 |
| | | | | | $ 298 | $ (824) | $ 1.122 | 0,03 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| American Airlines Group, Inc. | 5,000 % | 20.12.2016 | FBF | $ 650 | $ 24 | $ 13 | $ 11 | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.03.2020 | GST | 6.050 | (4.177) | 306 | (4.483) | (0,42) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.03.2020 | JPM | 5.050 | (3.487) | 193 | (3.680) | (0,35) |
| Community Health Systems, Inc. | 5,000 % | 20.12.2020 | GST | 3.800 | (117) | 23 | (140) | (0,01) |
| Community Health Systems, Inc. | 5,000 % | 20.12.2020 | JPM | 2.250 | (69) | 5 | (74) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 9.100 | (2.506) | (1.031) | (1.475) | (0,25) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.12.2019 | CBK | 6.400 | (948) | 302 | (1.250) | (0,09) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.06.2020 | CBK | 500 | (86) | 22 | (108) | (0,01) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.06.2020 | FBF | 700 | (120) | 33 | (153) | (0,01) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 2.100 | (383) | (9) | (374) | (0,04) |
| USG Corp. | 5,000 % | 20.03.2019 | GST | 2.750 | 280 | 344 | (64) | 0,03 |
| | | | | | $ (11.589) | $ 201 | $ (11.790) | (1,16) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-21 Index | 5,000 % | 20.12.2018 | BOA | $ 10.000 | $ 1.185 | $ 1.272 | $ (87) | 0,12 |
| CDX.HY-21 Index | 5,000 % | 20.12.2018 | CBK | 11.500 | 1.363 | 1.601 | (238) | 0,14 |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | BOA | 10.000 | 834 | 796 | 38 | 0,08 |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | JPM | 3.925 | 328 | 349 | (21) | 0,03 |
| | | | | | $ 3.710 | $ 4.018 | $ (308) | 0,37 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | DUB | BRL 65.900 | $ 73 | $ 11 | $ 62 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,720 % | 02.01.2018 | GLM | 25.500 | (147) | (9) | (138) | (0,01) |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | JPM | NZD 3.300 | 232 | 59 | 173 | 0,02 |
| | | | | | | $ 158 | $ 61 | $ 97 | 0,02 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | Ensco PLC | (86.918) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 1.425 | 15.08.2016 | GST | $ 88 | $ 0 | $ 88 | 0,01 |
| Zahlung | Canadian Natural ResourcesLtd. | (61.200) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.321 | 15.08.2016 | GST | (15) | 0 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | Noble Corp. PLC | (235.100) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.016 | 15.08.2016 | GST | 535 | 0 | 535 | 0,05 |
| Zahlung | Transocean Ltd. | (10.057) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 135 | 15.08.2016 | GST | 10 | 1 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | Schlumberger Ltd. | (15.900) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.142 | 11.10.2016 | GST | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| Zahlung | Transocean Ltd. | (41.400) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 554 | 17.10.2016 | GST | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| Zahlung | National Oilwell Varco, Inc. | (58.700) | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.035 | 17.10.2016 | GST | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| | | | | | | | $ 760 | $ 1 | $ 759 | 0,08 |

(1) Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 7.432 | AUD | 10.363 | AZD | $ 107 | $ 0 | $ 107 | 0,01 |
| 01/2016 | AUD | 10.363 | $ | 7.455 | NAB | 0 | (84) | (84) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 98.043 | | 25.958 | DUB | 1.176 | 0 | 1.176 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 25.021 | BRL | 98.043 | DUB | 0 | (239) | (239) | (0,02) |
| 01/2016 | | 3.566 | CNY | 23.072 | BPS | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.762 | | 62.955 | HUS | 0 | (144) | (144) | (0,01) |
| 01/2016 | | 21 | € | 19 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10 | | 10 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 31.531 | $ | 33.601 | HUS | 0 | (650) | (650) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 1.344 | € | 1.224 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 569 | $ | 619 | JPM | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 549 | € | 503 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 33.690 | | 30.876 | UAG | 29 | (179) | (150) | (0,02) |
| 01/2016 | JPY | 1.952.912 | $ | 15.988 | GLM | 0 | (247) | (247) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 16.129 | JPY | 1.952.912 | MSB | 105 | 0 | 105 | 0,01 |
| 01/2016 | KRW | 8.970.432 | $ | 7.715 | FBF | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.316 | KRW | 1.544.662 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 345 | | 400.593 | MSB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 517 | MYR | 2.198 | BRC | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 666 | | 2.860 | GLM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 31.933 | $ | 7.292 | HUS | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 320 | MYR | 1.409 | JPM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 10.363 | $ | 7.422 | AZD | 0 | (107) | (107) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 1.126 | AUD | 1.562 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 2.348 | $ | 1.678 | MSB | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 98.043 | | 24.776 | DUB | 246 | 0 | 246 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 1.601 | BRL | 6.515 | JPM | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 767 | $ | 578 | JPM | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 895 | € | 821 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 514 | $ | 563 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 29.876 | | 32.656 | UAG | 179 | 0 | 179 | 0,02 |
| 02/2016 | £ | 252 | | 385 | CBK | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 02/2016 | | 576 | | 875 | JPM | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 13.536 | | 1.747 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 15.274 | JPY | 1.879.571 | JPM | 363 | 0 | 363 | 0,04 |
| 02/2016 | JPY | 1.952.912 | $ | 16.138 | MSB | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| 02/2016 | NZD | 2.792 | | 1.845 | JPM | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 1.402 | NZD | 2.150 | JPM | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| 02/2016 | | 332 | SGD | 470 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 692 | | 977 | HUS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | SGD | 9.879 | $ | 7.017 | SCX | $ 65 | $ 0 | $ 65 | 0,01 |
| 02/2016 | THB | 249.407 | | 6.947 | BOA | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 315 | THB | 11.317 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 615 | | 22.329 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 227.707 | $ | 7.016 | BPS | 116 | 0 | 116 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 642 | TWD | 21.130 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 326 | | 10.639 | MSB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 5.473 | $ | 317 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 35.925 | | 5.459 | AZD | 133 | 0 | 133 | 0,01 |
| 09/2016 | | 144.201 | | 21.930 | SCX | 552 | 0 | 552 | 0,05 |
| 10/2016 | | 23.573 | | 3.600 | BRC | 112 | 0 | 112 | 0,01 |
| | | | | | | $ 3.480 | $ (2.043) | $ 1.437 | 0,14 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (6.185)** | **(0,62)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 979.461** | **98,01** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 267 | $ 394 | 0,04 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 67 | 67 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 840 | 611 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 6 | 5 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 68.697 | 571 | 0,06 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.853 | 1.853 | 0,19 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 678 | 6 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 17 | 12 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 20 | 20 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 7 | 5 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 578 | 578 | 0,06 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 7 | 7 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 557 | 557 | 0,06 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 492 | 358 | 0,04 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 594 | 427 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1.135 | 1.233 | 0,12 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 28.934 | 241 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 84 | 124 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 13 | 13 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 7.086** | **0,71** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 12.787** | **1,28** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 999.334** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der PIMCO Credit Absolute Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(b) **Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert in Höhe von USD 513 wurden als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Optionsgeschäfte regeln, zum 31. Dezember 2015 verpfändet.**

(d) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(e) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 812 und Barmittel in Höhe von USD 9.696 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.442 und Barmittel in Höhe von USD 3.646 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.116 und Barmittel von USD 2.248 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AWAS Leasing 2011-I Ltd. | 4,870 % | 02.10.2021 | 24.02.2011 | $ 4.278 | $ 4.393 | 0,44 |

**(i) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 111.751 | $ 854.086 | $ 22.768 | $ 988.605 |
| Finanzderivate[3] | (1.674) | (7.470) | 0 | (9.144) |
| **Summen** | **$ 110.077** | **$ 846.616** | **$ 22.768** | **$ 979.461** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 212.452 | $ 1.416.789 | $ 38.253 | $ 1.667.494 |
| Finanzderivate[3] | (103) | (11.838) | 44 | (11.897) |
| **Summen** | **$ 212.349** | **$ 1.404.951** | **$ 38.297** | **$ 1.655.597** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 3.771 | CHF 3.871 | BOA | $ 97 | $ 0 | $ 97 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 96 | $ 95 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 17 | 17 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.232 | 4.282 | CBK | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.333 | CHF 4.423 | DUB | 86 | 0 | 86 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 168 | $ 164 | FBF | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.204 | CHF 4.294 | JPM | 86 | 0 | 86 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 4.248 | $ 4.301 | JPM | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| 01/2016 | 3.937 | 3.970 | MSB | 41 | (4) | 37 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.248 | 4.300 | UAG | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 4.275 | CHF 4.341 | UAG | 62 | 0 | 62 | 0,01 |
| 02/2016 | 32 | 31 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 4.286 | 4.231 | CBK | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| 02/2016 | 4.377 | 4.318 | JPM | 0 | (58) | (58) | (0,01) |
| 02/2016 | 3.517 | 3.480 | MSB | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| 02/2016 | 4.305 | 4.248 | UAG | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | | | | $ 539 | $ (214) | $ 325 | 0,03 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 219.169 | $ 240.696 | BOA | $ 2.698 | $ (85) | $ 2.613 | 0,26 |
| 01/2016 | $ 252.412 | € 236.744 | BOA | 4.762 | 0 | 4.762 | 0,48 |
| 01/2016 | € 660 | $ 723 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | 922 | 1.002 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 72.224 | 79.060 | CBK | 737 | (133) | 604 | 0,06 |
| 01/2016 | $ 77 | € 71 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 541 | $ 578 | DUB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 182.402 | € 172.146 | GLM | 4.601 | 0 | 4.601 | 0,46 |
| 01/2016 | € 215.877 | $ 237.237 | HUS | 2.730 | 0 | 2.730 | 0,27 |
| 01/2016 | $ 252.878 | € 237.293 | HUS | 4.894 | 0 | 4.894 | 0,49 |
| 01/2016 | € 137.429 | $ 150.178 | JPM | 889 | 0 | 889 | 0,09 |
| 01/2016 | 5.881 | 6.254 | NAB | 0 | (134) | (134) | (0,01) |
| 01/2016 | 632 | 689 | RBC | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | 702 | 769 | SCX | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 8 | € 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 250.753 | 235.955 | UAG | 5.565 | 0 | 5.565 | 0,56 |
| 01/2016 | € 230.991 | $ 252.173 | UAG | 1.369 | (123) | 1.246 | 0,12 |
| 02/2016 | $ 237.374 | € 215.877 | BOA | 0 | (2.701) | (2.701) | (0,27) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € 1.078 | $ 1.185 | BOA | $ 13 | $ 0 | $ 13 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 240.761 | € 218.945 | HUS | 0 | (2.753) | (2.753) | (0,27) |
| 02/2016 | 150.281 | 137.429 | JPM | 0 | (886) | (886) | (0,09) |
| 02/2016 | € 7 | $ 8 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 238.500 | € 218.192 | UAG | 0 | (1.309) | (1.309) | (0,13) |
| | | | | $ 28.274 | $ (8.133) | $ 20.141 | 2,02 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 246 | $ 369 | BOA | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 6 | £ 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 303 | 201 | BPS | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | 1 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 188 | $ 280 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 304 | £ 201 | CBK | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | 304 | 201 | DUB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | 303 | 201 | HUS | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 124 | $ 184 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 424 | 638 | MSB | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 304 | £ 202 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 104 | $ 153 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 110 | £ 73 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 183 | 124 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 184 | 124 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 183 | 124 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 153 | 104 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 24 | $ (39) | $ (15) | 0,00 |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Markt-wert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 38.569 | $ 42.092 | $ (161) | $ 0 | $ (161) | (0,02) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 133 | $ 0 | $ 133 |
| BOA | 6.785 | (8.210) | (1.425) |
| BPS | (732) | 850 | 118 |
| BRC | (81) | 330 | 249 |
| CBK | 1.280 | (720) | 560 |
| DUB | 1.355 | (3.520) | (2.165) |
| FBF | (111) | 190 | 79 |
| GLM | 3.923 | (6.580) | (2.657) |
| GST | (6.118) | 6.122 | 4 |
| HUS | 3.769 | (5.010) | (1.241) |
| JPM | (2.746) | 2.936 | 190 |
| MSB | (27) | 50 | 23 |
| MYC | 634 | (810) | (176) |
| NAB | (218) | 30 | (188) |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| SCX | 665 | (540) | 125 |
| UAG | 5.593 | (7.370) | (1.777) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(m) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,92 | 99,13 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,17) | (0,01) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,12) | (0,55) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,62) | (0,15) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO Credit Absolute Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 68.792.938 | $ | 688.382 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | $ | 97.050 | | 90.257 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 52.825 | | 59.069 |
| US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | | 58.000 | | 57.576 |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.06.2020 | | 43.900 | | 43.746 |
| US Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 41.470 | | 41.205 |
| Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 39.780 | | 39.368 |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 31.07.2020 | | 36.100 | | 36.386 |
| Federal Home Loan Bank 0,080 % fällig am 07.08.2015 | | 31.200 | | 31.194 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 28.950 | | 30.077 |
| Spain Government Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025 | € | 25.400 | | 27.618 |
| Federal Home Loan Bank 0,039 % fällig am 15.07.2015 | $ | 26.900 | | 26.899 |
| US Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 23.400 | | 23.662 |
| US Treasury Bonds 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 22.100 | | 21.806 |
| Federal Home Loan Bank 0,040 % fällig am 08.07.2015 | | 21.300 | | 21.299 |
| US Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 21.540 | | 20.601 |
| Endo Ltd. 6,000 % fällig am 15.07.2023 | | 18.209 | | 18.151 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 18.656 | | 18.038 |
| Federal Home Loan Bank 0,040 % fällig am 10.07.2015 | | 16.800 | | 16.799 |
| Freddie Mac 0,100 % fällig am 29.10.2015 | | 16.100 | | 16.094 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 75.650.980 | $ | 757.000 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Fannie Mae 0,060 % fällig am 06.04.2015 | $ | 111.600 | | 111.588 |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 97.050 | | 87.875 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 52.825 | | 57.413 |
| Freddie Mac 0,070 % fällig am 09.04.2015 | | 48.000 | | 47.995 |
| Freddie Mac 0,155 % fällig am 21.07.2015 | | 45.300 | | 45.299 |
| Fannie Mae 0,079 % fällig am 01.05.2015 | | 35.100 | | 35.095 |
| Federal Home Loan Bank 0,080 % fällig am 07.08.2015 | | 31.200 | | 31.198 |
| Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 33.475 | | 30.345 |
| Spain Government Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025 | € | 25.400 | | 28.663 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | $ | 28.950 | | 28.655 |
| Freddie Mac 0,070 % fällig am 02.04.2015 | | 24.300 | | 24.296 |
| US Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 23.400 | | 23.207 |
| US Treasury Bonds 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 22.100 | | 21.967 |
| Novo Banco S.A. 5,000 % fällig am 23.04.2019 | € | 17.075 | | 20.127 |
| USG Corp. 9,750 % fällig am 15.01.2018 | $ | 15.810 | | 17.961 |
| OneMain Financial Holdings, Inc. 7,250 % fällig am 15.12.2021 | | 15.400 | | 16.263 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 15.725 | | 16.130 |
| Fannie Mae 0,205 % fällig am 14.01.2016 | $ | 16.100 | | 16.097 |
| Freddie Mac 0,100 % fällig am 29.10.2015 | | 16.100 | | 16.097 |

(a) Der PIMCO Credit Absolute Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.06.2019 | $ | 18.333 | $ 13.762 | 0,24 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **Heta Asset Resolution AG (a)** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.05.2016 | CHF | 36.485 | 24.238 | 0,42 |
| 4,250 % fällig am 31.10.2016 (b) | € | 7.196 | 5.315 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 24.01.2017 | | 82.350 | 60.831 | 1,07 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.07.2017 | $ | 8.700 | 9.081 | 0,16 |
| | | | 99.465 | 1,74 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 59.800 | 65.335 | 1,15 |
| **KBC Groep NV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.03.2049 | € | 4.915 | 5.352 | 0,09 |
| | | | 70.687 | 1,24 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **Weatherford International Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2038 | $ | 2.000 | 1.397 | 0,02 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2018 | € | 4.600 | 4.688 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | $ | 35.286 | 26.994 | 0,47 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico eSocial** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.09.2017 | € | 2.500 | 2.552 | 0,04 |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | $ | 20.800 | 20.540 | 0,36 |
| 6,500 % fällig am 10.06.2019 | | 3.310 | 3.252 | 0,06 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2016 | | 27.500 | 27.514 | 0,48 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 17.509 | 4.224 | 0,07 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 2.539 | 513 | 0,01 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 233 | 44 | 0,00 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 115.000 | 20.797 | 0,36 |
| **CSN Islands XI Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.09.2019 (b) | $ | 5.800 | 3.074 | 0,05 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 19.900 | 15.174 | 0,27 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 500 | 331 | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 37.100 | 27.732 | 0,49 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 6.300 | 4.961 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 (b) | | 24.200 | 17.424 | 0,31 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 8.900 | 5.807 | 0,10 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 500 | 444 | 0,01 |
| | | | 186.065 | 3,26 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 37.000 | 27.750 | 0,48 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 20.03.2017 | | 4.000 | 4.104 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 18.07.2016 | | 1.500 | 1.538 | 0,03 |
| | | | 33.392 | 0,58 |
| **KANADA** | | | | |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | | 3.000 | 2.325 | 0,04 |
| **Telesat Canada** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2019 | | 1.448 | 1.430 | 0,03 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.08.2020 | | 4.500 | 4.328 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 7.347 | 7.097 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 13.800 | 13.086 | 0,23 |
| | | | 28.266 | 0,50 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Air 2 US** | | | | |
| 8,027 % fällig am 01.10.2019 | $ | 249 | $ 266 | 0,00 |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.05.2021 | | 8.430 | 8.425 | 0,15 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 0,601 % fällig am 10.05.2021 | | 289 | 287 | 0,01 |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | | 2.963 | 2.958 | 0,05 |
| **LCM X LP** | | | | |
| 1,581 % fällig am 15.04.2022 | | 4.859 | 4.851 | 0,09 |
| **Lima Metro Line 2 Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 6.200 | 6.045 | 0,11 |
| **Lockwood Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 1,690 % fällig am 25.01.2024 | | 2.800 | 2.790 | 0,05 |
| **Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 42.390 | 15.684 | 0,27 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 368 | 85 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 179 | 43 | 0,00 |
| **Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2018 | | 646 | 618 | 0,01 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | |
| 1,303 % fällig am 28.07.2035 | £ | 5.300 | 7.098 | 0,12 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 100 | 179 | 0,00 |
| | | | 49.329 | 0,86 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | $ | 34.600 | 34.539 | 0,60 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 14.400 | 11.585 | 0,20 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 8.200 | 7.788 | 0,14 |
| | | | 53.912 | 0,94 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 53.100 | 44.604 | 0,78 |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.09.2023 | | 400 | 369 | 0,01 |
| | | | 44.973 | 0,79 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | | 9.400 | 7.872 | 0,14 |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 5.300 | 4.459 | 0,08 |
| | | | 12.331 | 0,22 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 9.500 | 9.001 | 0,16 |
| 7,450 % fällig am 30.04.2044 | | 5.300 | 5.367 | 0,09 |
| | | | 14.368 | 0,25 |
| **EL SALVADOR** | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 10.880 | 9.261 | 0,16 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 2.520 | 2.161 | 0,04 |
| | | | 11.422 | 0,20 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **AXA S.A.** | | | | |
| 5,453 % fällig am 29.11.2049 | £ | 7.900 | 11.702 | 0,21 |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | | 3.600 | 5.329 | 0,09 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.700 | 5.857 | 0,10 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2025 | | 13.700 | 13.167 | 0,23 |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | | 26.400 | 25.729 | 0,45 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 500 | 527 | 0,01 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.09.2041 | £ | 5.500 | 9.079 | 0,16 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 31.400 | $ 32.485 | 0,57 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 22.500 | 25.175 | 0,44 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 9.000 | 9.231 | 0,16 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 9.386 | 10.382 | 0,18 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2025 | € | 5.600 | 5.718 | 0,10 |
| **La Mondiale SAM** | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | | 13.365 | 14.678 | 0,26 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | $ | 2.200 | 2.186 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2022 (b) | € | 4.100 | 4.565 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 25.500 | 28.151 | 0,49 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 16.900 | 16.435 | 0,29 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | | 1.600 | 1.548 | 0,03 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | € | 20.100 | 21.827 | 0,38 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.04.2025 | $ | 9.000 | 8.509 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | | 18.100 | 18.476 | 0,32 |
| | | | 270.756 | 4,74 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | € | 4.800 | 4.819 | 0,08 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | | 300 | 314 | 0,01 |
| | | | 5.133 | 0,09 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 808.000 | 6.045 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 08.11.2016 | | 1.050.000 | 8.292 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 03.07.2017 | | 1.000.000 | 7.648 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | | 2.756.200 | 22.110 | 0,39 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 626.600 | 5.020 | 0,09 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 22.900 | 23.135 | 0,40 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 452.400 | 3.461 | 0,06 |
| | | | 75.711 | 1,33 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 ClassA Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | $ | 15.884 | 16.267 | 0,28 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | € | 20.700 | 21.266 | 0,37 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | $ | 49.325 | 44.713 | 0,78 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 27.200 | 29.221 | 0,51 |
| **Majapahit Holding BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | | 14.270 | 16.000 | 0,28 |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | | 10.081 | 11.316 | 0,20 |
| **Pelabuhan Indonesia III PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 6.400 | 6.048 | 0,11 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2021 | | 14.742 | 15.055 | 0,27 |
| | | | 143.619 | 2,52 |
| **IRLAND** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 4.550 | 4.669 | 0,08 |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 25.900 | 28.399 | 0,50 |
| **Borets Finance Ltd.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 26.09.2018 | | 41.000 | 33.742 | 0,59 |
| **Brunswick Rail Finance Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2017 | | 22.900 | 10.420 | 0,18 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 3,424 % fällig am 27.02.2021 | | 17.587 | 17.446 | 0,31 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.** | | | | |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | | 32.400 | 32.562 | 0,57 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| PIMCO US Short-Term Fund (c) | | 5.533.276 | $ 55.333 | 0,97 |
| | | | 182.571 | 3,20 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ITALIEN** | | | | |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | € | 5.700 | 6.217 | 0,11 |
| Banco Popolare SC | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 5.700 | 6.357 | 0,11 |
| Finmeccanica SpA | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 45.800 | 78.930 | 1,38 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 12.500 | 12.319 | 0,22 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 33.131 | 37.622 | 0,66 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 (b) | € | 59.500 | 76.730 | 1,34 |
| | | | 218.175 | 3,82 |
| **JAPAN** | | | | |
| SoftBank Group Corp. | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.07.2025 | | 4.100 | 4.334 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 30.07.2027 | | 4.200 | 4.443 | 0,08 |
| | | | 8.777 | 0,15 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| Kazakhstan Government International Bond | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 27.800 | 27.495 | 0,48 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 5.100 | 5.034 | 0,09 |
| Samruk-Energy JSC | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 2.500 | 2.450 | 0,04 |
| Zhaikmunai LLP | | | | |
| 6,375 % fällig am 14.02.2019 | | 19.000 | 14.962 | 0,26 |
| | | | 49.941 | 0,87 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Altice Financing S.A. | | | | |
| 5,250 % fällig am 04.02.2022 | | 995 | 994 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 34.365 | 37.336 | 0,65 |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 2.400 | 2.376 | 0,04 |
| ContourGlobal Power Holdings S.A. | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.06.2019 | | 2.900 | 2.762 | 0,05 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | | 500 | 500 | 0,01 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 7.950 | 8.024 | 0,14 |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 19.455 | 21.011 | 0,37 |
| Intelsat Jackson Holdings S.A. | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.06.2019 | | 3.200 | 3.035 | 0,05 |
| Nielsen Co. Luxembourg SARL | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | | 38.700 | 39.813 | 0,70 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 27.950 | 29.881 | 0,52 |
| Telecom Italia Capital S.A. | | | | |
| 7,721 % fällig am 04.06.2038 | $ | 27.552 | 28.861 | 0,51 |
| Telenet Finance V Luxembourg S.C.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.08.2022 | € | 5.000 | 5.873 | 0,10 |
| Wind Acquisition Finance S.A. | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | | 42.000 | 45.625 | 0,80 |
| | | | 226.091 | 3,96 |
| **MARSHALLINSELN** | | | | |
| Nakilat, Inc. | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 16.550 | 18.255 | 0,32 |
| Seadrill Operating LP | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.02.2021 | | 3.659 | 1.514 | 0,03 |
| | | | 19.769 | 0,35 |
| **MEXIKO** | | | | |
| Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 62.840 | 62.919 | 1,10 |
| Cemex SAB de C.V. | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.03.2023 | € | 4.600 | 4.548 | 0,08 |
| 5,071 % fällig am 15.10.2018 | $ | 1.200 | 1.176 | 0,02 |
| 9,500 % fällig am 15.06.2018 | $ | 28.800 | $ 30.816 | 0,54 |
| Desarrolladora Homex SAB de C.V. | | | | |
| 7,500 % fällig am 28.09.2015 (a) | | 4.200 | 84 | 0,00 |
| | | AKTIEN | | |
| Hipotecaria Su Casita S.A. deC.V. | | 28.925 | 0 | 0,00 |
| | | PARI (000S) | | |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 16.900 | 15.378 | 0,27 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | $ | 25.960 | 23.072 | 0,40 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 38.200 | 34.896 | 0,61 |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 5.400 | 4.323 | 0,08 |
| 3,750 % fällig am 16.04.2026 | | 8.000 | 7.344 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2044 | $ | 11.200 | 8.482 | 0,15 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | | 5.200 | 3.999 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 33.800 | 29.389 | 0,51 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 10.600 | 9.527 | 0,17 |
| Urbi Desarrollos Urbanos SAB de C.V. | | | | |
| 9,500 % fällig am 21.01.2020 (a) | | 500 | 2 | 0,00 |
| | | | 235.955 | 4,13 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.01.2049 | € | 3.400 | 3.753 | 0,07 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.500 | 6.810 | 0,12 |
| EMF-NL Prime | | | | |
| 0,748 % fällig am 17.04.2041 | € | 83 | 84 | 0,00 |
| Eurosail-NL BV | | | | |
| 1,448 % fällig am 17.10.2040 | | 971 | 1.046 | 0,02 |
| ING Bank NV | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 51.600 | 56.150 | 0,98 |
| ING Groep NV | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.800 | 1.767 | 0,03 |
| NN Group NV | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | € | 20.500 | 21.957 | 0,38 |
| RWE Finance BV | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 2.900 | 4.847 | 0,09 |
| Schaeffler Finance BV | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 41.200 | 43.637 | 0,76 |
| Schaeffler Holding Finance BV | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 (d) | $ | 1.700 | 1.836 | 0,03 |
| Volkswagen Financial Services NV | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2019 | £ | 1.300 | 1.895 | 0,03 |
| Ziggo BV | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2022 | € | 10.532 | 11.209 | 0,20 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2022 | | 9.568 | 10.183 | 0,18 |
| Ziggo Secured Finance BV | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | | 2.300 | 2.319 | 0,04 |
| | | | 167.493 | 2,93 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| Eksportfinans ASA | | | | |
| 0,720 % fällig am 28.07.2016 | JPY | 100.000 | 829 | 0,01 |
| **PANAMA** | | | | |
| Panama Government International Bond | | | | |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | $ | 21.600 | 25.758 | 0,45 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 600 | 784 | 0,01 |
| | | | 26.542 | 0,46 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Banco Espirito Santo S.A. | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | € | 200 | 30 | 0,00 |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 6.048 | 5.719 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 15.899 | 15.177 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 16.581 | 15.789 | 0,28 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 2.890 | 2.810 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 13.480 | 13.251 | 0,23 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 2.900 | 3.032 | 0,05 |
| | | | 55.808 | 0,98 |
| **KATAR** | | | | |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | $ | 24.000 | $ 26.515 | 0,46 |
| 6,332 % fällig am 30.09.2027 | | 3.270 | 3.697 | 0,07 |
| | | | 30.212 | 0,53 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| Romania Government International Bond | | | | |
| 2,875 % fällig am 28.10.2024 | € | 10.400 | 11.696 | 0,21 |
| 3,625 % fällig am 24.04.2024 | | 8.800 | 10.480 | 0,18 |
| | | | 22.176 | 0,39 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| ALROSA Finance S.A. | | | | |
| 7,750 % fällig am 03.11.2020 | $ | 550 | 581 | 0,01 |
| Lukoil International Finance BV | | | | |
| 7,250 % fällig am 05.11.2019 | | 800 | 864 | 0,02 |
| | | | 1.445 | 0,03 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2022 | | 1.229 | 982 | 0,02 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | € | 5.600 | 6.436 | 0,11 |
| Autonomous Community of Valencia | | | | |
| 2,289 % fällig am 03.09.2017 | | 100 | 110 | 0,00 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 19.400 | 20.729 | 0,37 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 17.400 | 17.816 | 0,31 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 (b) | | 61.100 | 72.466 | 1,27 |
| | | | 117.557 | 2,06 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| Credit Suisse AG | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 63.350 | 68.405 | 1,20 |
| Credit Suisse Group AG | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 2.400 | 2.530 | 0,04 |
| UBS AG | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 62.965 | 65.876 | 1,15 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 28.313 | 32.320 | 0,57 |
| UBS Group AG | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 4.300 | 4.912 | 0,09 |
| | | | 174.043 | 3,05 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| AABS Ltd. | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.01.2038 | $ | 3.529 | 3.492 | 0,06 |
| Bank of Scotland PLC | | | | |
| 7,281 % fällig am 29.05.2049 | £ | 700 | 1.218 | 0,02 |
| 9,375 % fällig am 15.05.2021 | | 1.400 | 2.627 | 0,05 |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 650 | 742 | 0,01 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 37.984 | 72.337 | 1,27 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 13.430 | 25.641 | 0,45 |
| Barclays PLC | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 6.900 | 10.190 | 0,18 |
| Canary Wharf Finance II PLC | | | | |
| 6,800 % fällig am 22.04.2030 | | 69 | 125 | 0,00 |
| Co-operative Group Holdings 2011 Ltd. | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 43.681 | 70.284 | 1,23 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 5.630 | 9.104 | 0,16 |
| Enterprise Inns PLC | | | | |
| 6,500 % fällig am 06.12.2018 (b) | | 2.300 | 3.632 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 2.200 | 3.457 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 2.200 | 3.340 | 0,06 |
| HBOS PLC | | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | € | 4.500 | 5.634 | 0,10 |
| HSBC Holdings PLC | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 5.500 | 5.904 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 5.400 | 5.920 | 0,10 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | € | 21.665 | $ 33.714 | 0,59 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 16.732 | 33.564 | 0,59 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 22.04.2025 | | 400 | 756 | 0,01 |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 3.100 | 4.423 | 0,08 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,033 % fällig am 15.12.2030 | £ | 5.819 | 7.712 | 0,14 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | $ | 2.900 | 3.220 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 3.300 | 3.444 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 1.200 | 1.272 | 0,02 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | £ | 300 | 411 | 0,01 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 9.802 | 15.134 | 0,26 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | $ | 10.100 | 10.541 | 0,18 |
| **Stonegate Pub Co. Financing PLC** | | | | |
| 5,329 % fällig am 15.04.2019 | £ | 2.600 | 3.841 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2019 | | 1.500 | 2.255 | 0,04 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 1.665 | 2.572 | 0,04 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 12.974 | 18.026 | 0,32 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 20.940 | 26.262 | 0,46 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 6.525 | 9.612 | 0,17 |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 2.470 | 3.809 | 0,07 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 23.500 | 31.883 | 0,56 |
| **William Hill PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.06.2020 | | 1.200 | 1.808 | 0,03 |
| | | | 437.906 | 7,67 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | $ | 7.750 | 7.765 | 0,14 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,581 % fällig am 16.06.2042 | | 1.100 | 1.138 | 0,02 |
| 2,831 % fällig am 15.01.2043 | | 200 | 206 | 0,00 |
| 3,200 % fällig am 16.05.2044 | | 554 | 568 | 0,01 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,136 % fällig am 15.03.2038 | £ | 5.591 | 7.114 | 0,13 |
| **Springleaf Funding Trust** | | | | |
| 3,920 % fällig am 16.01.2023 | $ | 2.900 | 2.900 | 0,05 |
| | | | 19.691 | 0,35 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Albertson's LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 25.08.2019 | | 8.085 | 8.019 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2021 | | 15.880 | 15.771 | 0,28 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | | 6.063 | 5.954 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 04.01.2021 | | 5.241 | 5.150 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 24.08.2021 | | 1.600 | 1.590 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 24.01.2023 | | 4.000 | 3.997 | 0,07 |
| **Commscope, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.12.2022 | | 1.696 | 1.687 | 0,03 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 16.168 | 16.067 | 0,28 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 22.356 | 22.309 | 0,39 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.10.2018 | | 10.030 | 10.014 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 51.867 | 51.618 | 0,90 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 12.303 | 12.305 | 0,22 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 18.607 | 18.590 | 0,33 |
| **Las Vegas Sands LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 6.040 | 5.974 | 0,10 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.12.2019 | | 1.287 | 1.273 | 0,02 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | $ | 11.892 | $ 11.613 | 0,20 |
| **Numericable US LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.05.2020 | | 7.128 | 6.890 | 0,12 |
| **Station Casinos LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 02.03.2020 | | 14.984 | 14.728 | 0,26 |
| **Texas Competitive Electric Holdings Co. LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.11.2016 | | 5.906 | 5.876 | 0,10 |
| | | | 219.425 | 3,84 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2017 | | 18.100 | 18.371 | 0,32 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 300 | 300 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 13.02.2018 | | 16.650 | 16.608 | 0,29 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 19.500 | 19.549 | 0,34 |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 18.200 | 17.995 | 0,31 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 6.400 | 6.384 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 10.09.2018 | | 10.400 | 10.673 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 400 | 413 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2017 | | 8.110 | 8.526 | 0,15 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 10,200 % fällig am 06.02.2039 | | 13.072 | 21.499 | 0,38 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 15.11.2041 | | 800 | 815 | 0,01 |
| **Associated Materials LLC** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.11.2017 | | 5.000 | 3.475 | 0,06 |
| **Aviation Loan Trust 2013-2** | | | | |
| 2,622 % fällig am 15.09.2021 | | 4.021 | 3.725 | 0,07 |
| **Barrick North America Finance LLC** | | | | |
| 5,700 % fällig am 30.05.2041 | | 1.100 | 739 | 0,01 |
| **Bruce Mansfield Unit 1 2007 Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,850 % fällig am 01.06.2034 | | 2.492 | 2.507 | 0,04 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 328 | 118 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 5.835 | 1.867 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 (b) | | 9.621 | 2.958 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 (b) | | 16.652 | 8.805 | 0,15 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | | 2.100 | 2.188 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 39.730 | 43.676 | 0,76 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 5.900 | 5.886 | 0,10 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 500 | 506 | 0,01 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 58.205 | 16.443 | 0,29 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | | 21.200 | 21.730 | 0,38 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | | 400 | 413 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 34.751 | 35.967 | 0,63 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2019 | | 2.100 | 2.200 | 0,04 |
| **Consol Energy, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2022 | | 9.600 | 6.000 | 0,10 |
| **Continental Airlines 2010-1 Class B Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 12.01.2019 | | 432 | 449 | 0,01 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2022 | | 3.400 | 2.512 | 0,04 |
| **COX Communications, Inc.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.03.2039 | | 5.000 | 5.525 | 0,10 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 21.875 | 21.711 | 0,38 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 1.700 | 1.517 | 0,03 |
| **Doctors Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | | 10.100 | 10.856 | 0,19 |
| **Dynegy, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.11.2019 | | 7.575 | 7.158 | 0,13 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 2.200 | 2.338 | 0,04 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | | 10.500 | 10.703 | 0,19 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 6.100 | 6.280 | 0,11 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | | 26.380 | 32.211 | 0,56 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | | 700 | 699 | 0,01 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.03.2043 | $ | 1.300 | $ 682 | 0,01 |
| **Hamilton College** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.07.2113 | | 3.500 | 2.914 | 0,05 |
| **Hartford HealthCare Corp.** | | | | |
| 5,746 % fällig am 01.04.2044 | | 3.200 | 3.474 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 17.600 | 17.468 | 0,31 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 (b) | | 2.800 | 2.989 | 0,05 |
| **iStar, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.11.2017 | | 8.900 | 8.749 | 0,15 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | | 5.900 | 5.214 | 0,09 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.03.2041 | | 3.710 | 3.105 | 0,05 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 11.790 | 10.153 | 0,18 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.01.2032 | | 15.609 | 14.878 | 0,26 |
| 7,800 % fällig am 01.08.2031 | | 7.425 | 6.982 | 0,12 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 30.871 | 28.942 | 0,51 |
| **MPLX LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 | | 1.500 | 1.350 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 01.12.2024 | | 17.400 | 15.703 | 0,27 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2025 | | 16.000 | 14.400 | 0,25 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2023 | | 1.200 | 1.056 | 0,02 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.09.2017 | | 500 | 494 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 17.06.2019 | | 31.350 | 28.920 | 0,51 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 9.100 | 8.531 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 4.100 | 4.061 | 0,07 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 77.009 | 81.244 | 1,42 |
| **Northwest Airlines 2000-1 Class G Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,150 % fällig am 01.10.2019 | | 435 | 457 | 0,01 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.01.2018 | | 46.800 | 49.023 | 0,86 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.12.2021 | | 4.850 | 4.874 | 0,09 |
| **PHH Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | | 30.500 | 27.907 | 0,49 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 9.423 | 8.957 | 0,16 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | | 1.700 | 1.630 | 0,03 |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | | 5.500 | 4.771 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 15.03.2043 | | 7.222 | 6.145 | 0,11 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 22.500 | 19.960 | 0,35 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 5.000 | 4.719 | 0,08 |
| **Reliance Steel & Aluminum Co.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 932 | 0,02 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 28.350 | 21.014 | 0,37 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | | 44.800 | 41.440 | 0,73 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | | 3.150 | 3.008 | 0,05 |
| 6,850 % fällig am 15.07.2018 | | 61.886 | 60.958 | 1,07 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 13.900 | 12.858 | 0,23 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 1.400 | 1.235 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 54.525 | 46.346 | 0,81 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 11.075 | 9.691 | 0,17 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.11.2016 | | 2.050 | 2.050 | 0,04 |
| **Selectica, Inc.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 31.12.2049 | | 750 | 0 | 0,00 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2016 | | 200 | 203 | 0,00 |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 14.700 | 15.251 | 0,27 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 6.200 | 4.805 | 0,08 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 20.000 | 14.525 | 0,25 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 33.900 | 25.669 | 0,45 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 42.200 | 31.798 | 0,56 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 1.451 | 1.412 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Terraform Global Operating LLC** | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | $ 16.800 | $ 13.482 | 0,24 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | 700 | 683 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | 1.400 | 1.334 | 0,02 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | 5.200 | 4.943 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | 1.300 | 1.309 | 0,02 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2023 | 19.983 | 20.283 | 0,36 |
| 6,250 % fällig am 01.04.2021 | 14.950 | 15.436 | 0,27 |
| 6,542 % fällig am 28.04.2020 | 9.900 | 10.346 | 0,18 |
| 6,731 % fällig am 28.04.2022 | 5.800 | 6.061 | 0,11 |
| 6,836 % fällig am 28.04.2023 | 1.000 | 1.038 | 0,02 |
| **UAL 2007-1 Pass-Through Trust** | | | |
| 7,336 % fällig am 02.07.2019 | 316 | 337 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 4,672 % fällig am 15.03.2055 | 12.900 | 11.246 | 0,20 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 0,810 % fällig am 20.11.2017 | 1.100 | 1.057 | 0,02 |
| 0,848 % fällig am 22.05.2018 | 2.000 | 1.899 | 0,03 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | |
| 7,950 % fällig am 15.03.2025 | 12.900 | 16.010 | 0,28 |
| **Williams Cos., Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 24.06.2044 | 3.000 | 1.786 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2031 | 1.800 | 1.248 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 400 | 302 | 0,01 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 45.800 | 40.991 | 0,72 |
| | | 1.215.033 | 21,28 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **7 WTC Depositor LLC Trust** | | | |
| 4,082 % fällig am 13.03.2031 | 100 | 102 | 0,00 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,552 % fällig am 25.02.2037 | 1.585 | 1.522 | 0,03 |
| 0,690 % fällig am 25.09.2035 | 300 | 279 | 0,01 |
| 0,700 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 168 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | 3.700 | 3.267 | 0,06 |
| 0,742 % fällig am 25.12.2035 | 660 | 630 | 0,01 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.04.2036 | 1.162 | 1.045 | 0,02 |
| 0,577 % fällig am 25.08.2036 | 1.756 | 1.473 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.08.2036 (a) | 2.844 | 1.064 | 0,02 |
| 0,722 % fällig am 25.02.2036 | 4.000 | 3.606 | 0,06 |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | 600 | 515 | 0,01 |
| 1,042 % fällig am 25.02.2036 (a) | 200 | 166 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.11.2035 | 1.200 | 1.031 | 0,02 |
| 1,217 % fällig am 25.01.2035 | 1.342 | 1.245 | 0,02 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2034 | 1.898 | 1.717 | 0,03 |
| 1,397 % fällig am 25.06.2034 | 975 | 942 | 0,02 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,529 % fällig am 25.01.2035 | 315 | 322 | 0,01 |
| 2,666 % fällig am 25.02.2036 (a) | 252 | 214 | 0,00 |
| 2,819 % fällig am 25.01.2036 (a) | 811 | 717 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,852 % fällig am 25.12.2035 | 200 | 145 | 0,00 |
| 0,862 % fällig am 25.06.2035 | 300 | 280 | 0,01 |
| 1,422 % fällig am 25.03.2035 (a) | 923 | 853 | 0,02 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,792 % fällig am 25.10.2035 | 7.991 | 7.896 | 0,14 |
| 0,872 % fällig am 25.10.2035 | 400 | 367 | 0,01 |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,361 % fällig am 25.04.2047 | 1.821 | 1.544 | 0,03 |
| 0,562 % fällig am 25.08.2037 | 1.375 | 1.186 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.12.2046 (a) | 885 | 938 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 20.02.2047 (a) | 493 | 372 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | 1.384 | 1.360 | 0,02 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 (a) | 196 | 191 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 20.09.2046 | 940 | 823 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.11.2036 | 233 | 230 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.07.2046 (a) | 218 | 204 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (a) | 864 | 758 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.10.2046 | 390 | 382 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | 275 | 209 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (a) | 198 | 145 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.06.2035 | 272 | 246 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.07.2035 | 201 | 170 | 0,00 |
| 0,732 % fällig am 25.08.2035 (a) | $ 348 | $ 281 | 0,01 |
| 0,743 % fällig am 20.11.2035 | 121 | 98 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.06.2036 (a) | 146 | 100 | 0,00 |
| 1,737 % fällig am 25.01.2036 | 1.274 | 1.175 | 0,02 |
| 3,167 % fällig am 25.07.2046 (a) | 261 | 215 | 0,00 |
| 3,400 % fällig am 25.08.2018 | 138 | 126 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2018 | 83 | 84 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 (a) | 372 | 344 | 0,01 |
| 5,269 % fällig am 25.05.2036 | 915 | 784 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (a) | 1.242 | 1.150 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (a) | 1.825 | 1.653 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 (a) | 629 | 492 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2035 | 911 | 922 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 (a) | 370 | 331 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (a) | 903 | 804 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | 635 | 592 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (a) | 1.942 | 1.801 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | 1.996 | 1.589 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 1.344 | 1.140 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | 2.952 | 2.271 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | 372 | 303 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (a) | 444 | 371 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | 91 | 76 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2047 (a) | 712 | 622 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 (a) | 513 | 418 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 545 | 552 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | 1.592 | 1.254 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037 (a) | 1.700 | 1.407 | 0,02 |
| 20,087 % fällig am 25.02.2036 | 1.013 | 1.242 | 0,02 |
| **Alternative Loan Trust Resecuritization** | | | |
| 3,942 % fällig am 25.03.2047 | 315 | 296 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | 605 | 526 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Assets Trust (a)** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 | 1.492 | 1.071 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.06.2037 | 419 | 305 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,154 % fällig am 25.09.2045 | 59 | 58 | 0,00 |
| 2,404 % fällig am 25.12.2035 | 1.527 | 1.056 | 0,02 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | |
| 0,812 % fällig am 25.03.2036 | 100 | 88 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,872 % fällig am 25.01.2036 | 1.000 | 939 | 0,02 |
| 0,882 % fällig am 25.07.2035 | 2.000 | 1.931 | 0,03 |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | 1.500 | 1.466 | 0,03 |
| 0,922 % fällig am 25.09.2035 | 3.000 | 2.765 | 0,05 |
| 1,027 % fällig am 25.11.2034 | 45 | 45 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.05.2035 | 1.000 | 823 | 0,01 |
| 1,367 % fällig am 25.08.2034 | 400 | 375 | 0,01 |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | 300 | 270 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 503 | 449 | 0,01 |
| 1,532 % fällig am 25.03.2035 | 200 | 162 | 0,00 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 1,422 % fällig am 25.10.2034 | 309 | 305 | 0,01 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.05.2036 | 1.036 | 385 | 0,01 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.01.2037 | 335 | 207 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | 1.163 | 722 | 0,01 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | 388 | 243 | 0,00 |
| 1,097 % fällig am 25.06.2035 | 500 | 481 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.03.2034 | 936 | 754 | 0,01 |
| **Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,292 % fällig am 25.07.2034 | 596 | 534 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity LoanTrust** | | | |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | 700 | 684 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2035 | 600 | 544 | 0,01 |
| 1,062 % fällig am 25.07.2035 | 1.000 | 916 | 0,02 |
| 1,576 % fällig am 15.08.2033 | 1.213 | 1.159 | 0,02 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust (a)** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | 428 | 366 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 | 372 | 308 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Ltd.** | | | |
| 0,503 % fällig am 03.10.2039 | 97 | 96 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 20.04.2047 (a) | 1.393 | 1.101 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 20.06.2047 | 2.202 | 2.122 | 0,04 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2037 | 825 | 706 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.05.2037 (a) | 193 | 143 | 0,00 |
| 0,922 % fällig am 26.06.2035 | 841 | 790 | 0,01 |
| 2,858 % fällig am 20.09.2035 (a) | $ 623 | $ 540 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | 521 | 518 | 0,01 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,635 % fällig am 25.02.2036 (a) | 12 | 11 | 0,00 |
| 2,745 % fällig am 25.01.2035 | 247 | 235 | 0,00 |
| 2,810 % fällig am 25.07.2035 (a) | 67 | 63 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (a) | 136 | 115 | 0,00 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,732 % fällig am 25.04.2036 | 200 | 180 | 0,00 |
| **Bayview Financial Asset Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.12.2039 | 56 | 55 | 0,00 |
| **BCAP LLC** | | | |
| 0,351 % fällig am 26.06.2037 | 93 | 91 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,391 % fällig am 26.08.2046 | 1.000 | 934 | 0,02 |
| 0,407 % fällig am 26.07.2036 | 280 | 267 | 0,00 |
| 0,474 % fällig am 26.05.2047 | 266 | 258 | 0,00 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2047 (a) | 1.026 | 787 | 0,01 |
| 1,072 % fällig am 25.09.2047 | 236 | 203 | 0,00 |
| 2,782 % fällig am 26.07.2036 | 531 | 481 | 0,01 |
| 2,932 % fällig am 28.09.2036 | 77 | 76 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,500 % fällig am 25.02.2036 (a) | 229 | 193 | 0,00 |
| 2,599 % fällig am 25.06.2035 (a) | 71 | 63 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | 9.439 | 9.481 | 0,17 |
| 2,686 % fällig am 25.03.2035 | 119 | 117 | 0,00 |
| 2,706 % fällig am 25.05.2034 | 70 | 68 | 0,00 |
| 2,727 % fällig am 25.12.2046 (a) | 380 | 329 | 0,01 |
| 2,735 % fällig am 25.01.2035 | 14 | 13 | 0,00 |
| 2,749 % fällig am 25.07.2036 (a) | 132 | 112 | 0,00 |
| 2,842 % fällig am 25.10.2035 | 246 | 245 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.07.2034 | 451 | 444 | 0,01 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,742 % fällig am 25.01.2047 (a) | 410 | 295 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2035 | 657 | 637 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2036 (a) | 307 | 242 | 0,00 |
| 2,416 % fällig am 25.03.2036 | 977 | 680 | 0,01 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | 246 | 209 | 0,00 |
| 2,760 % fällig am 25.11.2036 | 824 | 631 | 0,01 |
| 2,820 % fällig am 25.05.2036 (a) | 1.089 | 754 | 0,01 |
| 2,956 % fällig am 25.08.2036 (a) | 597 | 449 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.04.2031 | 156 | 157 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | 907 | 868 | 0,02 |
| 0,612 % fällig am 25.05.2037 | 330 | 313 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.12.2036 | 1.815 | 1.662 | 0,03 |
| 0,692 % fällig am 25.06.2036 | 300 | 258 | 0,00 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 (a) | 1.700 | 1.663 | 0,03 |
| 0,852 % fällig am 25.12.2035 | 500 | 459 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.12.2035 | 300 | 276 | 0,01 |
| 1,092 % fällig am 25.06.2035 | 1.000 | 890 | 0,02 |
| 1,122 % fällig am 25.11.2035 (a) | 86 | 75 | 0,00 |
| 1,382 % fällig am 25.04.2035 | 153 | 144 | 0,00 |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | 409 | 380 | 0,01 |
| 1,672 % fällig am 25.08.2037 | 588 | 541 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.10.2036 | 994 | 954 | 0,02 |
| 0,742 % fällig am 25.01.2047 | 959 | 904 | 0,02 |
| 0,972 % fällig am 25.06.2036 | 300 | 263 | 0,00 |
| 1,622 % fällig am 25.01.2045 | 346 | 278 | 0,01 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 2,693 % fällig am 26.01.2036 | 411 | 340 | 0,01 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.01.2037 | 470 | 342 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.10.2036 | 1.647 | 969 | 0,02 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | 1.200 | 725 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | 2.338 | 1.584 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.10.2036 | 1.647 | 979 | 0,02 |
| 0,682 % fällig am 25.02.2037 | 3.100 | 2.228 | 0,04 |
| 0,882 % fällig am 25.06.2035 | 2.700 | 2.624 | 0,05 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.10.2035 | 200 | 193 | 0,00 |
| **Chase Funding Trust** | | | |
| 6,333 % fällig am 25.04.2032 | 1.324 | 1.351 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.02.2037 | 113 | 77 | 0,00 |
| 2,466 % fällig am 25.03.2037 (a) | 227 | 213 | 0,00 |
| 2,765 % fällig am 25.03.2037 (a) | 970 | 820 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 25.01.2036 (a) | 1.046 | 963 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 (a) | 118 | 101 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 252 | 220 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Chaseflex Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.07.2037 | $ 418 | $ 341 | 0,01 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | 204 | 214 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.12.2036 | 949 | 866 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.09.2036 | 1.556 | 1.147 | 0,02 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | 900 | 827 | 0,01 |
| 0,621 % fällig am 25.11.2046 | 454 | 384 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.05.2037 | 1.920 | 1.394 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.12.2036 | 1.600 | 1.185 | 0,02 |
| 0,662 % fällig am 25.10.2036 | 1.482 | 1.440 | 0,03 |
| 0,662 % fällig am 25.11.2036 | 1.000 | 903 | 0,02 |
| 0,671 % fällig am 25.11.2045 | 300 | 273 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.01.2037 | 300 | 245 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.12.2035 | 818 | 775 | 0,01 |
| 1,157 % fällig am 25.09.2035 (a) | 500 | 414 | 0,01 |
| 2,311 % fällig am 25.10.2046 (a) | 315 | 259 | 0,00 |
| 2,383 % fällig am 25.09.2037 | 200 | 192 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.02.2034 | 296 | 294 | 0,01 |
| 2,623 % fällig am 25.03.2034 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,643 % fällig am 25.07.2046 (a) | 799 | 702 | 0,01 |
| 2,905 % fällig am 25.09.2037 (a) | 366 | 333 | 0,01 |
| 3,108 % fällig am 25.09.2037 (a) | 1.887 | 1.596 | 0,03 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust (a)** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | 159 | 138 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | 1.992 | 1.750 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.06.2036 | 19 | 19 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.02.2037 | 158 | 154 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.07.2037 (a) | 7.089 | 6.184 | 0,11 |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | 667 | 636 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | 1.420 | 1.366 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | 3.760 | 3.428 | 0,06 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2047 (a) | 1.660 | 1.491 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2034 | 5.289 | 4.969 | 0,09 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | 1.175 | 1.203 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2046 | 1.010 | 921 | 0,02 |
| 0,592 % fällig am 25.03.2037 | 646 | 670 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | 133 | 124 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 25.06.2047 | 287 | 272 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.09.2047 | 67 | 67 | 0,00 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2036 | 961 | 946 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.08.2036 | 1.344 | 1.327 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.09.2036 | 367 | 363 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2047 | 333 | 305 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2047 | 529 | 488 | 0,01 |
| 0,642 % fällig am 25.06.2037 | 2.000 | 1.424 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.09.2037 (a) | 375 | 311 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 25.10.2047 | 962 | 854 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2036 | 302 | 301 | 0,01 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2036 | 1.700 | 1.519 | 0,03 |
| 0,722 % fällig am 25.07.2036 | 500 | 458 | 0,01 |
| 0,732 % fällig am 25.09.2037 (a) | 656 | 331 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2036 (a) | 2.046 | 1.939 | 0,03 |
| 0,772 % fällig am 25.04.2036 | 100 | 89 | 0,00 |
| 0,782 % fällig am 25.02.2036 | 125 | 118 | 0,00 |
| 0,812 % fällig am 25.06.2036 | 874 | 843 | 0,02 |
| 0,822 % fällig am 25.06.2036 | 400 | 292 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.03.2047 (a) | 173 | 129 | 0,00 |
| 0,912 % fällig am 25.12.2035 | 1.000 | 988 | 0,02 |
| 0,982 % fällig am 25.04.2034 | 16 | 14 | 0,00 |
| 0,982 % fällig am 25.12.2035 | 1.500 | 1.422 | 0,03 |
| 1,082 % fällig am 25.12.2035 | 400 | 342 | 0,01 |
| 1,172 % fällig am 25.03.2034 | 310 | 299 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.08.2035 | 100 | 89 | 0,00 |
| 1,922 % fällig am 25.02.2035 | 300 | 263 | 0,00 |
| 2,027 % fällig am 25.01.2034 (a) | 105 | 99 | 0,00 |
| 2,822 % fällig am 25.01.2034 (a) | 1.466 | 1.060 | 0,02 |
| 4,399 % fällig am 25.04.2036 | 1.000 | 1.010 | 0,02 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | 3.239 | 2.913 | 0,05 |
| 5,049 % fällig am 25.10.2046 (a) | 2.605 | 2.477 | 0,04 |
| 5,397 % fällig am 25.04.2047 (a) | 294 | 323 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.04.2046 (a) | 3.098 | 3.110 | 0,05 |
| 0,572 % fällig am 25.03.2047 | 409 | 366 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 | 485 | 450 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.04.2036 | 1.746 | 1.725 | 0,03 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2036 | 1.323 | 1.289 | 0,02 |
| 0,872 % fällig am 25.04.2036 | 200 | 177 | 0,00 |
| 0,882 % fällig am 25.05.2036 | 300 | 245 | 0,00 |
| 0,922 % fällig am 25.08.2047 | 37 | 36 | 0,00 |
| 0,952 % fällig am 25.02.2036 | $ 300 | $ 259 | 0,00 |
| 1,002 % fällig am 25.11.2035 | 100 | 91 | 0,00 |
| 1,022 % fällig am 25.08.2035 | 1.292 | 1.281 | 0,02 |
| 1,042 % fällig am 25.08.2035 | 200 | 192 | 0,00 |
| 1,142 % fällig am 25.07.2034 | 254 | 236 | 0,00 |
| 1,152 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 343 | 0,01 |
| 1,222 % fällig am 25.08.2047 | 1.000 | 860 | 0,02 |
| 1,277 % fällig am 25.08.2034 | 709 | 674 | 0,01 |
| 4,723 % fällig am 25.09.2046 (a) | 55 | 200 | 0,00 |
| 4,740 % fällig am 25.10.2035 | 382 | 389 | 0,01 |
| 4,816 % fällig am 25.02.2036 | 2.400 | 2.342 | 0,04 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,672 % fällig am 25.03.2036 | 255 | 199 | 0,00 |
| 0,762 % fällig am 25.03.2035 | 189 | 154 | 0,00 |
| 1,217 % fällig am 25.04.2046 (a) | 1.296 | 728 | 0,01 |
| 2,561 % fällig am 20.04.2035 | 60 | 60 | 0,00 |
| 2,561 % fällig am 20.12.2035 | 304 | 253 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.09.2037 (a) | 382 | 336 | 0,01 |
| 2,718 % fällig am 25.09.2047 (a) | 22 | 20 | 0,00 |
| 2,770 % fällig am 25.10.2035 (a) | 868 | 761 | 0,01 |
| 2,905 % fällig am 20.10.2035 | 238 | 216 | 0,00 |
| 2,970 % fällig am 20.11.2035 (a) | 354 | 287 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | 1.007 | 1.043 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 (a) | 1.064 | 1.051 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 | 174 | 169 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | 370 | 342 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | 3.037 | 2.967 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 99 | 94 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 (a) | 79 | 77 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 (a) | 1.956 | 1.800 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 (a) | 488 | 441 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,265 % fällig am 25.06.2033 | 72 | 70 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 (a) | 842 | 605 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 2,732 % fällig am 26.04.2047 | 445 | 445 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 28.04.2037 | 548 | 394 | 0,01 |
| 2,862 % fällig am 26.05.2036 | 951 | 965 | 0,02 |
| 2,962 % fällig am 26.11.2035 | 363 | 364 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-BackedTrust (a)** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | 436 | 363 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 | 1.237 | 874 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 25.08.2036 | 1.535 | 1.229 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 | 1.108 | 838 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 0,320 % fällig am 27.03.2036 | 158 | 155 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.07.2037 | 396 | 256 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 0,672 % fällig am 25.07.2036 | 2.000 | 1.443 | 0,03 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.01.2047 | 336 | 273 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.08.2047 | 360 | 290 | 0,01 |
| **Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.** | | | |
| 0,437 % fällig am 27.11.2036 | 500 | 435 | 0,01 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 28.05.2037 | 480 | 476 | 0,01 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,671 % fällig am 25.05.2043 | 168 | 163 | 0,00 |
| 0,747 % fällig am 25.11.2041 | 4 | 4 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | 1.518 | 1.447 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.04.2036 | 380 | 320 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.04.2036 | 400 | 259 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | 500 | 354 | 0,01 |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | 1.787 | 1.677 | 0,03 |
| 0,892 % fällig am 25.07.2035 | 4.405 | 4.265 | 0,07 |
| 0,902 % fällig am 25.12.2035 | 1.470 | 1.399 | 0,02 |
| 0,952 % fällig am 25.09.2035 | 2.000 | 1.899 | 0,03 |
| 1,097 % fällig am 25.06.2036 | 343 | 332 | 0,01 |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | 1.000 | 979 | 0,02 |
| 1,232 % fällig am 25.04.2035 | 261 | 247 | 0,00 |
| 1,247 % fällig am 25.01.2035 | 204 | 197 | 0,00 |
| 1,307 % fällig am 25.03.2035 | 1.000 | 929 | 0,02 |
| 1,367 % fällig am 25.03.2035 | 100 | 84 | 0,00 |
| 1,622 % fällig am 25.01.2035 | 122 | 102 | 0,00 |
| 1,847 % fällig am 25.10.2034 | 591 | 499 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (a)** | | | |
| 2,448 % fällig am 25.06.2036 | 243 | 200 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 | 167 | 132 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,725 % fällig am 25.09.2035 | $ 1.788 | $ 1.730 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 25.10.2020 | 6 | 6 | 0,00 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.05.2035 | 325 | 276 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.02.2036 | 4.531 | 3.895 | 0,07 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 | 1.740 | 987 | 0,02 |
| **GE Commercial Mortgage Corporation Trust** | | | |
| 5,543 % fällig am 10.12.2049 | 1.700 | 1.750 | 0,03 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust (a)** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.10.2046 | 481 | 341 | 0,01 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | 76 | 50 | 0,00 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.04.2047 | 406 | 334 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 25.03.2036 (a) | 331 | 314 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.08.2037 | 571 | 520 | 0,01 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 0,472 % fällig am 25.12.2046 | 408 | 223 | 0,00 |
| 0,512 % fällig am 25.01.2037 | 169 | 102 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 471 | 445 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | 977 | 749 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.12.2035 | 213 | 196 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | 2.400 | 1.479 | 0,03 |
| 0,812 % fällig am 25.01.2036 | 1.000 | 837 | 0,01 |
| 1,292 % fällig am 25.11.2034 | 1.060 | 977 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.12.2034 | 24 | 21 | 0,00 |
| 2,010 % fällig am 25.04.2032 | 92 | 85 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.11.2035 | 735 | 709 | 0,01 |
| 2,771 % fällig am 25.04.2035 | 92 | 92 | 0,00 |
| 2,793 % fällig am 25.09.2035 | 986 | 996 | 0,02 |
| 2,835 % fällig am 25.03.2047 (a) | 555 | 482 | 0,01 |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (a) | 74 | 69 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 645 | 631 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 (a) | 172 | 157 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | 448 | 434 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 (a) | 1.204 | 978 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 (a) | 562 | 483 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 19.06.2035 | 1.352 | 1.207 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 19.03.2035 | 105 | 93 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 19.11.2035 | 645 | 541 | 0,01 |
| 1,102 % fällig am 19.01.2035 | 1.046 | 744 | 0,01 |
| 2,789 % fällig am 19.07.2035 (a) | 277 | 235 | 0,00 |
| 2,800 % fällig am 19.08.2036 (a) | 208 | 167 | 0,00 |
| 2,886 % fällig am 19.07.2035 | 169 | 166 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 19.06.2036 (a) | 465 | 291 | 0,01 |
| 4,730 % fällig am 19.08.2036 (a) | 13 | 12 | 0,00 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 1,517 % fällig am 25.07.2035 | 2.000 | 1.825 | 0,03 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.04.2037 | 2.000 | 1.137 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.11.2036 | 715 | 572 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.04.2037 | 1.453 | 898 | 0,02 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.12.2036 | 1.296 | 1.152 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2035 | 591 | 512 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.01.2036 | 1.100 | 962 | 0,02 |
| 0,692 % fällig am 25.10.2035 | 939 | 875 | 0,02 |
| 0,752 % fällig am 25.10.2035 | 1.315 | 1.230 | 0,02 |
| **HSBC Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 20.03.2036 | 2.000 | 1.901 | 0,03 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.12.2036 | 731 | 312 | 0,01 |
| 0,642 % fällig am 25.11.2035 | 1.853 | 1.137 | 0,02 |
| 0,702 % fällig am 25.01.2037 | 5.000 | 3.079 | 0,05 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.05.2037 (a) | 426 | 305 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | 212 | 183 | 0,00 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2047 | 550 | 399 | 0,01 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.06.2046 | 1.901 | 1.455 | 0,03 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2035 | 21 | 19 | 0,00 |
| 0,722 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 347 | 0,01 |
| 2,302 % fällig am 25.06.2037 (a) | 142 | 108 | 0,00 |
| 2,511 % fällig am 25.11.2035 (a) | 1.950 | 1.672 | 0,03 |
| 2,578 % fällig am 25.07.2037 | 93 | 64 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 2,652 % fällig am 25.08.2035 | $ 1.992 | $ 1.642 | 0,03 |
| 2,656 % fällig am 25.10.2034 | 857 | 827 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.11.2035 (a) | 175 | 163 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 25.05.2037 (a) | 633 | 486 | 0,01 |
| 4,182 % fällig am 25.06.2036 | 396 | 367 | 0,01 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 1,202 % fällig am 25.06.2035 | 509 | 506 | 0,01 |
| 1,352 % fällig am 25.09.2035 | 379 | 359 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,799 % fällig am 26.05.2037 | 5.445 | 4.893 | 0,09 |
| 2,692 % fällig am 25.05.2036 (a) | 633 | 519 | 0,01 |
| 2,782 % fällig am 25.05.2037 (a) | 739 | 615 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.02.2036 | 382 | 368 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | 456 | 445 | 0,01 |
| 0,712 % fällig am 25.05.2035 | 1.000 | 922 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.01.2036 | 200 | 185 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | 756 | 739 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2037 | 1.000 | 926 | 0,02 |
| 0,592 % fällig am 25.04.2036 | 742 | 699 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | 100 | 82 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2037 | 300 | 222 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | 1.000 | 805 | 0,01 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | 200 | 142 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.01.2037 | 300 | 221 | 0,00 |
| 3,422 % fällig am 25.01.2037 (a) | 1.057 | 727 | 0,01 |
| 5,059 % fällig am 25.11.2036 | 600 | 607 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,537 % fällig am 25.08.2035 | 323 | 320 | 0,01 |
| 2,555 % fällig am 25.11.2035 | 158 | 149 | 0,00 |
| 2,607 % fällig am 25.10.2035 (a) | 554 | 502 | 0,01 |
| 2,618 % fällig am 25.07.2035 | 106 | 105 | 0,00 |
| 2,690 % fällig am 25.10.2036 (a) | 1.604 | 1.365 | 0,02 |
| 2,708 % fällig am 25.04.2035 | 119 | 119 | 0,00 |
| 4,504 % fällig am 25.06.2037 (a) | 1.099 | 994 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2037 (a) | 30 | 29 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 (a) | 217 | 186 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 (a) | 431 | 328 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | |
| 0,693 % fällig am 26.06.2036 | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,726 % fällig am 27.08.2037 | 123 | 124 | 0,00 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,512 % fällig am 25.06.2037 | 503 | 312 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.06.2037 | 258 | 163 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2047 (a) | 105 | 103 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 25.04.2046 (a) | 111 | 88 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.09.2046 (a) | 28 | 6 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.02.2046 | 669 | 481 | 0,01 |
| 1,121 % fällig am 25.08.2047 | 1.669 | 1.138 | 0,02 |
| 1,222 % fällig am 25.10.2035 | 961 | 902 | 0,02 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,752 % fällig am 25.01.2046 | 23 | 21 | 0,00 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | 500 | 432 | 0,01 |
| 1,322 % fällig am 25.06.2035 | 1.500 | 1.397 | 0,02 |
| 1,352 % fällig am 25.04.2035 | 2.900 | 2.836 | 0,05 |
| 1,472 % fällig am 25.06.2035 | 400 | 307 | 0,01 |
| 1,697 % fällig am 25.02.2035 | 200 | 160 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 0,521 % fällig am 25.05.2047 (a) | 613 | 388 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.08.2036 | 3.082 | 1.472 | 0,03 |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | 565 | 489 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.02.2036 | 577 | 320 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.03.2036 | 2.000 | 1.239 | 0,02 |
| 0,852 % fällig am 25.06.2035 | 917 | 877 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 25.10.2035 (a) | 581 | 433 | 0,01 |
| 1,112 % fällig am 25.03.2035 | 164 | 143 | 0,00 |
| **Mastr Specialized Loan Trust** | | | |
| 1,172 % fällig am 25.11.2035 | 200 | 152 | 0,00 |
| **Meritage Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,172 % fällig am 25.11.2035 | 439 | 431 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.03.2037 | 355 | 164 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 | 461 | 422 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | 1.051 | 985 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.08.2037 | 5.059 | 3.083 | 0,05 |
| 0,592 % fällig am 25.07.2037 | 1.802 | 961 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2036 | $ 591 | $ 584 | 0,01 |
| 0,732 % fällig am 25.08.2036 | 300 | 275 | 0,01 |
| 0,802 % fällig am 25.08.2035 | 1.837 | 1.679 | 0,03 |
| 0,872 % fällig am 25.02.2047 | 194 | 133 | 0,00 |
| 0,882 % fällig am 25.04.2029 | 109 | 105 | 0,00 |
| 0,902 % fällig am 25.05.2036 | 442 | 407 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.04.2035 | 622 | 582 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.10.2035 | 323 | 315 | 0,01 |
| 2,502 % fällig am 25.02.2036 | 306 | 300 | 0,01 |
| 2,658 % fällig am 25.03.2036 (a) | 835 | 564 | 0,01 |
| 2,798 % fällig am 25.11.2035 | 700 | 698 | 0,01 |
| 5,463 % fällig am 25.05.2036 | 948 | 884 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,040 % fällig am 25.04.2037 (a) | 68 | 58 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc.Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.10.2036 | 107 | 59 | 0,00 |
| 0,522 % fällig am 25.09.2036 | 5 | 2 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | 1.477 | 826 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.11.2036 | 321 | 200 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.10.2036 | 278 | 173 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | 5.270 | 3.162 | 0,06 |
| 0,582 % fällig am 25.09.2036 | 1.857 | 1.033 | 0,02 |
| 0,642 % fällig am 25.11.2036 | 401 | 253 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | 1.444 | 754 | 0,01 |
| 0,732 % fällig am 25.12.2035 | 495 | 445 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.11.2035 | 689 | 680 | 0,01 |
| 1,067 % fällig am 25.09.2035 | 500 | 442 | 0,01 |
| 1,127 % fällig am 25.12.2034 | 316 | 288 | 0,01 |
| 1,277 % fällig am 25.03.2034 | 1.685 | 1.608 | 0,03 |
| 1,352 % fällig am 25.03.2035 | 300 | 296 | 0,01 |
| 1,412 % fällig am 25.06.2035 | 2.730 | 2.466 | 0,04 |
| 1,672 % fällig am 25.07.2037 | 400 | 275 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | |
| 1,446 % fällig am 15.12.2048 (e) | 44.713 | 2.197 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | |
| 5,439 % fällig am 12.02.2044 | 152 | 151 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital I, Inc. Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 25.07.2032 | 284 | 275 | 0,01 |
| 1,772 % fällig am 25.02.2033 | 895 | 858 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.12.2036 | 2.345 | 1.327 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.04.2036 | 138 | 98 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 25.04.2037 | 527 | 301 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.04.2037 | 264 | 153 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.01.2047 (a) | 489 | 487 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2036 | 254 | 197 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.01.2035 | 96 | 90 | 0,00 |
| 2,217 % fällig am 25.06.2036 | 213 | 209 | 0,00 |
| 2,225 % fällig am 25.06.2036 | 16 | 16 | 0,00 |
| 3,046 % fällig am 25.09.2035 (a) | 561 | 458 | 0,01 |
| 4,287 % fällig am 25.05.2036 (a) | 979 | 765 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2036 (a) | 322 | 161 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 (a) | 2.069 | 1.715 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2047 (a) | 155 | 123 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | |
| 0,557 % fällig am 26.02.2037 | 391 | 265 | 0,00 |
| 0,567 % fällig am 26.03.2037 | 278 | 208 | 0,00 |
| 5,794 % fällig am 15.08.2045 | 854 | 878 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Resecuritization Trust** | | | |
| 0,531 % fällig am 26.01.2051 | 609 | 584 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 | 35 | 26 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 25.02.2036 | 19 | 19 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.12.2035 | 215 | 210 | 0,00 |
| 0,932 % fällig am 25.09.2035 | 1.400 | 1.273 | 0,02 |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | 463 | 405 | 0,01 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative LoanTrust** | | | |
| 2,975 % fällig am 25.08.2035 | 840 | 824 | 0,01 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,832 % fällig am 25.02.2036 | 200 | 182 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.01.2037 | 1.466 | 662 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.03.2037 | 1.652 | 868 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.01.2037 | 1.749 | 806 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.01.2036 | 167 | 155 | 0,00 |
| 2,297 % fällig am 25.03.2035 | 1.000 | 893 | 0,02 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.12.2035 | $ 1.230 | $ 1.092 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | 266 | 154 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | 228 | 139 | 0,00 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | 771 | 469 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.07.2037 | 3.971 | 2.483 | 0,04 |
| 0,782 % fällig am 25.01.2036 | 400 | 280 | 0,01 |
| 0,932 % fällig am 25.08.2035 | 400 | 308 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-BackedCertificates** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.11.2035 | 700 | 524 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.10.2036 (a) | 300 | 236 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 0,912 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 161 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-ThroughCertificates** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | 700 | 657 | 0,01 |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | 410 | 336 | 0,01 |
| 0,912 % fällig am 25.09.2035 | 600 | 485 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.07.2035 | 3.700 | 3.685 | 0,06 |
| 0,952 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 359 | 0,01 |
| 0,972 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 310 | 0,01 |
| 1,262 % fällig am 25.01.2036 | 100 | 96 | 0,00 |
| 1,367 % fällig am 25.06.2035 | 200 | 175 | 0,00 |
| 1,412 % fällig am 25.09.2034 | 977 | 927 | 0,02 |
| 1,472 % fällig am 25.10.2034 | 500 | 429 | 0,01 |
| 1,502 % fällig am 25.03.2035 | 1.000 | 920 | 0,02 |
| 1,547 % fällig am 25.03.2035 | 400 | 341 | 0,01 |
| 1,667 % fällig am 25.01.2036 | 300 | 272 | 0,01 |
| 2,222 % fällig am 25.12.2034 | 406 | 344 | 0,01 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 (a) | 200 | 187 | 0,00 |
| 1,772 % fällig am 25.01.2035 | 2.000 | 1.698 | 0,03 |
| **People's Financial Realty Mortgage Securities Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.09.2036 | 1.313 | 531 | 0,01 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,632 % fällig am 25.01.2037 | 1.000 | 831 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.11.2046 | 200 | 176 | 0,00 |
| 0,812 % fällig am 25.02.2036 | 400 | 336 | 0,01 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 (a) | 592 | 528 | 0,01 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 0,571 % fällig am 25.11.2046 | 380 | 329 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.06.2044 | 214 | 184 | 0,00 |
| 0,762 % fällig am 25.08.2036 | 600 | 533 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.09.2045 | 300 | 246 | 0,00 |
| 0,822 % fällig am 25.06.2047 | 150 | 143 | 0,00 |
| 0,902 % fällig am 25.03.2037 | 753 | 730 | 0,01 |
| 1,385 % fällig am 25.10.2045 | 250 | 228 | 0,00 |
| 1,622 % fällig am 25.09.2047 | 1.339 | 1.317 | 0,02 |
| 1,922 % fällig am 25.09.2047 | 500 | 411 | 0,01 |
| 1,971 % fällig am 25.06.2035 | 300 | 291 | 0,01 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | |
| 0,541 % fällig am 26.03.2037 | 175 | 172 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 26.05.2037 | 44 | 44 | 0,00 |
| 0,725 % fällig am 26.03.2036 | 108 | 107 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.05.2037 | 1.012 | 749 | 0,01 |
| 0,552 % fällig am 25.02.2037 | 1.337 | 1.168 | 0,02 |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | 1.364 | 1.129 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.02.2037 | 809 | 655 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | 1.515 | 829 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.08.2036 (a) | 608 | 478 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2036 (a) | 1.709 | 1.325 | 0,02 |
| 0,772 % fällig am 25.08.2035 (a) | 1.667 | 1.231 | 0,02 |
| 0,822 % fällig am 25.11.2036 (a) | 554 | 346 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.06.2034 | 74 | 73 | 0,00 |
| 3,230 % fällig am 25.02.2035 (a) | 205 | 168 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037 (a) | 270 | 211 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2034 | 2.099 | 2.162 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 (a) | 177 | 136 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 (a) | 1.438 | 1.221 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | 3.321 | 2.715 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 25.03.2037 (a) | 541 | 443 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 (a) | 746 | 643 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | 735 | 567 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,551 % fällig am 25.12.2035 | $ 427 | $ 298 | 0,01 |
| 0,552 % fällig am 25.11.2036 | 864 | 720 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | 283 | 274 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.06.2036 | 1.078 | 1.042 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 (a) | 2.050 | 1.767 | 0,03 |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | 250 | 221 | 0,00 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | 17 | 17 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.09.2036 | 900 | 804 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 | 4.400 | 4.062 | 0,07 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | 678 | 655 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | 100 | 86 | 0,00 |
| 0,802 % fällig am 25.02.2036 | 400 | 357 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.12.2035 | 3.000 | 2.883 | 0,05 |
| 0,822 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 246 | 0,00 |
| 0,832 % fällig am 25.11.2035 | 774 | 741 | 0,01 |
| 0,842 % fällig am 25.12.2035 | 400 | 344 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.11.2035 | 300 | 261 | 0,00 |
| 0,862 % fällig am 25.01.2036 | 4.000 | 3.818 | 0,07 |
| 0,882 % fällig am 25.09.2035 | 950 | 879 | 0,02 |
| 1,097 % fällig am 25.02.2035 | 1.311 | 1.254 | 0,02 |
| 1,187 % fällig am 25.03.2034 | 129 | 121 | 0,00 |
| 1,217 % fällig am 25.01.2035 | 197 | 187 | 0,00 |
| 1,247 % fällig am 25.07.2034 | 1.508 | 1.354 | 0,02 |
| 1,262 % fällig am 25.12.2034 | 53 | 51 | 0,00 |
| 1,292 % fällig am 25.05.2035 | 1.723 | 1.679 | 0,03 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,441 % fällig am 25.10.2034 | 115 | 107 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.02.2037 | 487 | 448 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.08.2046 | 497 | 484 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.02.2036 | 368 | 360 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | 1.000 | 778 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.10.2035 | 200 | 191 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust (a)** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | 177 | 155 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | 407 | 367 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 | 1.538 | 967 | 0,02 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust (a)** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | 485 | 436 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | 366 | 342 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 1,322 % fällig am 25.08.2032 | 93 | 83 | 0,00 |
| 1,472 % fällig am 25.06.2033 | 1.015 | 950 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.07.2036 | 1.741 | 1.328 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2036 | 1.976 | 1.200 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.05.2036 | 413 | 238 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.03.2036 | 305 | 248 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.12.2035 | 244 | 237 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.08.2035 (a) | 400 | 253 | 0,00 |
| 1,397 % fällig am 25.03.2035 | 617 | 589 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,387 % fällig am 20.01.2047 (a) | 17 | 14 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | 47 | 17 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | 30 | 29 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 | 121 | 104 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | 200 | 122 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.11.2037 | 1.100 | 597 | 0,01 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2037 | 278 | 160 | 0,00 |
| 0,812 % fällig am 25.12.2036 | 300 | 249 | 0,00 |
| 1,247 % fällig am 25.05.2035 | 628 | 591 | 0,01 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2037 (a) | 772 | 399 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.06.2037 | 472 | 412 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.10.2035 | 267 | 223 | 0,00 |
| 2,154 % fällig am 25.10.2037 (a) | 175 | 118 | 0,00 |
| 2,476 % fällig am 25.02.2035 | 1.049 | 1.038 | 0,02 |
| 2,579 % fällig am 25.09.2035 | 757 | 678 | 0,01 |
| 2,597 % fällig am 25.12.2035 (a) | 136 | 133 | 0,00 |
| 2,605 % fällig am 25.04.2035 | 38 | 36 | 0,00 |
| 2,655 % fällig am 25.10.2036 (a) | 245 | 182 | 0,00 |
| 2,675 % fällig am 25.11.2036 (a) | 1.332 | 1.046 | 0,02 |
| 2,718 % fällig am 25.11.2035 (a) | 172 | 137 | 0,00 |
| 2,877 % fällig am 25.09.2035 | 75 | 64 | 0,00 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 142 | 123 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 1.169 | 936 | 0,02 |
| 0,722 % fällig am 25.01.2036 | 313 | 250 | 0,00 |
| 1,112 % fällig am 25.06.2035 | 1.700 | 1.670 | 0,03 |
| 1,142 % fällig am 25.02.2035 | $ 1.000 | $ 949 | 0,02 |
| 1,187 % fällig am 25.08.2035 | 7.200 | 5.408 | 0,09 |
| 1,322 % fällig am 25.09.2034 | 671 | 645 | 0,01 |
| 1,397 % fällig am 25.10.2033 | 1.169 | 1.136 | 0,02 |
| 1,547 % fällig am 25.07.2033 | 116 | 111 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 25.04.2033 | 30 | 25 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2046 | 440 | 352 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.09.2047 | 132 | 113 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2036 | 349 | 292 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2047 | 1.626 | 1.238 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2036 | 205 | 147 | 0,00 |
| 0,722 % fällig am 25.08.2036 (a) | 720 | 318 | 0,01 |
| 1,062 % fällig am 19.10.2034 | 129 | 124 | 0,00 |
| 1,102 % fällig am 19.03.2034 | 17 | 17 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage LoanTrust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.03.2036 | 690 | 666 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | 1.204 | 1.061 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.02.2037 | 604 | 538 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 25.01.2037 | 3.653 | 2.215 | 0,04 |
| 0,672 % fällig am 25.09.2036 | 300 | 243 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.02.2036 | 1.000 | 961 | 0,02 |
| 0,792 % fällig am 25.04.2036 | 200 | 175 | 0,00 |
| 1,322 % fällig am 25.08.2037 | 437 | 416 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,488 % fällig am 25.06.2033 | 72 | 71 | 0,00 |
| 5,654 % fällig am 25.03.2034 | 677 | 697 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.09.2035 | 300 | 228 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2034 | 269 | 269 | 0,01 |
| **Suntrust Alternative Loan Trust (a)** | | | |
| 1,072 % fällig am 25.12.2035 | 1.087 | 850 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 | 1.251 | 1.123 | 0,02 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.09.2036 (a) | 839 | 797 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,383 % fällig am 25.09.2037 | 183 | 177 | 0,00 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.03.2036 | 3.468 | 3.160 | 0,06 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC Trust (a)** | | | |
| 2,687 % fällig am 20.03.2037 | 606 | 584 | 0,01 |
| 2,752 % fällig am 20.10.2035 | 355 | 323 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.07.2046 (a) | 5 | 0 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | 140 | 130 | 0,00 |
| 0,842 % fällig am 25.06.2044 | 1.110 | 1.007 | 0,02 |
| 1,053 % fällig am 25.12.2046 | 188 | 172 | 0,00 |
| 1,062 % fällig am 25.01.2045 | 1.337 | 1.269 | 0,02 |
| 1,067 % fällig am 25.07.2047 | 1.160 | 943 | 0,02 |
| 1,257 % fällig am 25.08.2046 | 1.379 | 1.154 | 0,02 |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | 16 | 15 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.04.2044 | 6 | 6 | 0,00 |
| 1,825 % fällig am 25.01.2037 (a) | 43 | 36 | 0,00 |
| 1,972 % fällig am 25.04.2037 (a) | 30 | 26 | 0,00 |
| 2,151 % fällig am 25.05.2046 | 150 | 129 | 0,00 |
| 2,151 % fällig am 25.10.2046 | 63 | 57 | 0,00 |
| 2,155 % fällig am 25.05.2037 (a) | 51 | 42 | 0,00 |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 (a) | 27 | 24 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 25.07.2037 (a) | 1.531 | 1.313 | 0,02 |
| 2,300 % fällig am 25.12.2036 (a) | 88 | 76 | 0,00 |
| 2,337 % fällig am 25.03.2036 | 649 | 618 | 0,01 |
| 2,378 % fällig am 25.08.2036 (a) | 196 | 171 | 0,00 |
| 2,408 % fällig am 25.09.2036 (a) | 476 | 432 | 0,01 |
| 2,446 % fällig am 25.04.2035 | 82 | 81 | 0,00 |
| 2,453 % fällig am 25.02.2033 | 50 | 50 | 0,00 |
| 2,568 % fällig am 25.12.2035 | 330 | 314 | 0,01 |
| 4,294 % fällig am 25.02.2037 (a) | 107 | 99 | 0,00 |
| 6,008 % fällig am 25.10.2036 (a) | 934 | 781 | 0,01 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABSTrust** | | | |
| 0,662 % fällig am 25.05.2036 | 1.481 | 1.061 | 0,02 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (a)** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2037 | 1.848 | 1.362 | 0,02 |
| 0,872 % fällig am 25.05.2035 | 738 | 584 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | 1.454 | 1.396 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | 468 | 463 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | 1.835 | 1.639 | 0,03 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 (a) | $ 238 | $ 217 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.05.2036 | 2.000 | 1.889 | 0,03 |
| 0,752 % fällig am 25.05.2036 | 300 | 243 | 0,00 |
| 0,882 % fällig am 25.11.2035 | 1.000 | 966 | 0,02 |
| 0,882 % fällig am 25.12.2035 | 500 | 482 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.02.2035 | 200 | 182 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-ThroughCertificates** | | | |
| 0,792 % fällig am 25.04.2034 | 4.312 | 4.139 | 0,07 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,645 % fällig am 25.07.2036 (a) | 2.096 | 1.984 | 0,04 |
| 2,658 % fällig am 25.03.2035 | 1.276 | 1.284 | 0,02 |
| 2,683 % fällig am 25.04.2035 | 1.055 | 1.069 | 0,02 |
| 2,710 % fällig am 25.07.2036 (a) | 3.217 | 3.147 | 0,06 |
| 2,714 % fällig am 25.04.2036 (a) | 1.301 | 1.231 | 0,02 |
| 2,733 % fällig am 25.10.2036 (a) | 159 | 152 | 0,00 |
| 2,735 % fällig am 25.10.2035 | 454 | 456 | 0,01 |
| 2,738 % fällig am 25.05.2036 (a) | 1.020 | 974 | 0,02 |
| 2,740 % fällig am 25.05.2035 | 84 | 85 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 (a) | 1.662 | 1.628 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 25.11.2034 | 1.150 | 1.157 | 0,02 |
| 2,809 % fällig am 25.11.2037 (a) | 613 | 544 | 0,01 |
| 5,601 % fällig am 25.12.2036 | 432 | 414 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | 16 | 17 | 0,00 |
| 5,856 % fällig am 25.04.2036 (a) | 49 | 47 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (a) | 1.771 | 1.748 | 0,03 |
| | | 511.586 | 8,96 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Alameda, California, Joint Powers Authority Lease Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,046 % fällig am 01.12.2044 | 2.700 | 3.544 | 0,06 |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | 2.450 | 2.591 | 0,05 |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | 4.950 | 5.014 | 0,09 |
| **Cook County, Illinois, Water Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,642 % fällig am 01.11.2029 | 150 | 168 | 0,00 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 6,449 % fällig am 15.02.2044 | 450 | 527 | 0,01 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,270 % fällig am 15.02.2050 | 800 | 931 | 0,02 |
| 8,084 % fällig am 15.02.2050 | 6.900 | 10.183 | 0,18 |
| **Fulton, Georgia, Municipal Electric Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | 5.500 | 6.537 | 0,11 |
| **Los Angeles, California, Los Angeles County Public Works Financing Authority Lease Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | 1.500 | 2.101 | 0,04 |
| **Riverside, California, Electric Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,605 % fällig am 01.10.2040 | 2.200 | 3.035 | 0,05 |
| **San Diego, California, Redevelopment Agency Tax Allocation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.09.2030 | 500 | 586 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2040 | 200 | 225 | 0,00 |
| **Suffolk, Massachusetts, Port Authority Special Facilities Revenue Bonds, Series 2011** | | | |
| 6,202 % fällig am 01.07.2031 | 500 | 581 | 0,01 |
| | | 36.023 | 0,63 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | |
| **HSBC Bank PLC** | | | |
| 0,430 % fällig am 06.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2019 bewertet mit $46.038. Die Rückkauferlöse betragen $44.502.) | 44.500 | 44.500 | 0,78 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 0,560 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022 bewertet mit $178.539. Die Rückkauferlöse betragen $172.711.) | $ 172.700 | $ 172.700 | 3,02 |
| **Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith** | | | |
| 0,420 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043 bewertet mit $53.066. Die Rückkauferlöse betragen $52.902.) | 52.900 | 52.900 | 0,93 |
| **Wells Fargo Bank, National Association** | | | |
| 0,480 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.10.2019 bewertet mit $101.659. Die Rückkauferlöse betragen $99.505.) | 99.500 | 99.500 | 1,74 |
| **Wells Fargo Securities LLC** | | | |
| 0,600 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.12.2045 bewertet mit $103.084. Die Rückkauferlöse betragen $100.007.) | $ 100.000 | $ 100.000 | 1,75 |
| | | 469.600 | 8,22 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **US Treasury Bills (f)** | | | |
| 0,235 % fällig am 07.01.2016 | 80 | 80 | 0,00 |
| 0,561 % fällig am 30.06.2016 | 19.200 | 19.154 | 0,34 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 30.06.2018 (g) (h) | 119.800 | 120.294 | 2,11 |
| | | 139.528 | 2,45 |
| Summe USA | | 2.610.886 | 45,73 |
| **URUGUAY** | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | 23.700 | 20.500 | 0,36 |
| **VENEZUELA** | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 | $ 31.510 | $ 11.501 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 | 101.975 | 37.272 | 0,65 |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 | 100 | 42 | 0,00 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 | 6.100 | 2.455 | 0,05 |
| | | 51.270 | 0,90 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 4.392.751 | 43.936 | 0,77 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 5.833.719 | 102,17 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 849 | $ (537) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 671 | 1.725 | 0,03 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 42 | 118 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 2.999 | (812) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 5.583 | (2.630) | (0,05) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 763 | 415 | 0,01 |
| | | | | $ (1.721) | (0,03) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (1.721)** | **(0,03)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 374.000 | $ (1.410) | (0,02) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,000 % | 17.12.2020 | AUD 38.500 | $ (42) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 7.800 | (22) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | £ 89.900 | 1.164 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 10.300 | 99 | 0,00 |
| | | | | | $ 1.199 | 0,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (211)** | **0,00** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | CNH 6,615 | 18.08.2016 | $ 68.787 | $ 1.458 | $ 2.142 | 0,04 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - iTraxx Europe Series 24 Index | BRC | Verkauf | 1,050 % | 20.01.2016 | € 54.500 | $ (121) | $ (6) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | $ 7.200 | (16) | (7) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 18.400 | (35) | (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 51.700 | (109) | (48) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 18.400 | (39) | (10) | 0,00 |
| | | | | | | $ (320) | $ (74) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,107 | 02.03.2016 | € 60.700 | $ (549) | $ (559) | (0,01) |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,023 | 02.03.2016 | 60.700 | (550) | (113) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | CNH 6,985 | 18.08.2016 | $ 68.787 | (830) | (860) | (0,02) |
| | | | | | $ (1.929) | $ (1.532) | (0,03) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Alcoa, Inc. | 1,000 % | 20.06.2021 | BPS | $ 7.000 | $ (1.032) | $ (657) | $ (375) | (0,02) |
| Alcoa, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 100 | (12) | (20) | 8 | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | € 300 | 5 | (4) | 9 | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 200 | 3 | (3) | 6 | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2020 | BOA | 10.000 | 66 | 147 | (81) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | $ 850 | (124) | (53) | (71) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2023 | BPS | 5.900 | (1.387) | (248) | (1.139) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | BRC | 8.000 | (1.084) | (233) | (851) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BRC | 1.650 | (240) | (101) | (139) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 2.000 | (330) | (69) | (261) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | BRC | 29.600 | (5.638) | (1.283) | (4.355) | (0,10) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | CBK | 5.500 | (1.048) | (237) | (811) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | DUB | 16.700 | (3.181) | (739) | (2.442) | (0,06) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 1.500 | (219) | (91) | (128) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | GST | 3.800 | (724) | (168) | (556) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | HUS | 5.450 | (794) | (324) | (470) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 1.900 | (296) | (139) | (157) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | JPM | 3.200 | (466) | (190) | (276) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | RYL | 3.000 | (571) | (125) | (446) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | 300 | (210) | (31) | (179) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | GST | 800 | (485) | (78) | (407) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | GST | 400 | (263) | (25) | (238) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 1.500 | (1.049) | (175) | (874) | (0,02) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 400 | (280) | (39) | (241) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | MYC | 1.300 | (789) | (101) | (688) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.03.2019 | MYC | 600 | (385) | (41) | (344) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | MYC | 200 | (140) | (20) | (120) | 0,00 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 550 | (197) | (92) | (105) | 0,00 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 26.000 | (9.329) | (4.685) | (4.644) | (0,16) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 1.700 | (610) | (349) | (261) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 3.700 | (1.328) | (770) | (558) | (0,02) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 5.100 | (1.830) | (662) | (1.168) | (0,03) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 500 | (179) | (79) | (100) | 0,00 |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | € 3.600 | (972) | (172) | (800) | (0,02) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 6.400 | (1.728) | (704) | (1.024) | (0,03) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 5.700 | (1.539) | (609) | (930) | (0,03) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 13.200 | (3.564) | (1.441) | (2.123) | (0,06) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 9.700 | (2.619) | (1.048) | (1.571) | (0,05) |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | $ 7.500 | (632) | (591) | (41) | (0,01) |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 9.700 | (234) | (254) | 20 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 300 | (10) | (11) | 1 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2022 | BRC | 12.500 | (723) | (458) | (265) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2021 | CBK | 29.700 | (1.057) | (1.325) | 268 | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2021 | HUS | 27.100 | (965) | (1.161) | 196 | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2022 | UAG | 8.900 | (515) | (326) | (189) | (0,01) |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2023 | BRC | 7.400 | (555) | (202) | (353) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 15.000 | (3.726) | (777) | (2.949) | (0,07) |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PHH Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | BRC | $ 15.100 | $ 437 | $ 1.311 | $ (874) | 0,01 |
| PHH Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | CBK | 4.000 | 116 | 321 | (205) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 6.400 | (587) | (731) | 144 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | BRC | 8.100 | (583) | (1.300) | 717 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BRC | 7.600 | (598) | (706) | 108 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 15.800 | (1.449) | (2.006) | 557 | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 400 | (31) | (37) | 6 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 18.050 | (1.540) | (1.836) | 296 | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | HUS | 5.200 | (409) | (489) | 80 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 20.600 | (1.757) | (2.257) | 500 | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 7.400 | (679) | (856) | 177 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 6.300 | (578) | (739) | 161 | (0,01) |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | BRC | € 7.000 | (197) | 1 | (198) | 0,00 |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | JPM | 3.200 | (90) | 5 | (95) | 0,00 |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | MYC | 900 | (25) | 6 | (31) | 0,00 |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.12.2019 | CBK | $ 2.500 | (370) | 132 | (502) | (0,01) |
| Teck Resources Ltd. | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 10.800 | (3.934) | (356) | (3.578) | (0,07) |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | € 6.100 | (102) | (349) | 247 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2021 | SOG | 16.800 | (280) | (356) | 76 | 0,00 |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | $ 29.200 | (2.025) | (1.832) | (193) | (0,04) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | CBK | 35.000 | (2.208) | (2.102) | (106) | (0,04) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | HUS | 24.200 | (1.527) | (1.472) | (55) | (0,03) |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | 5,000 % | 20.06.2016 | GST | 14.600 | 272 | (230) | 502 | 0,00 |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | BOA | 5.900 | (3.722) | (3.302) | (420) | (0,07) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | BOA | 6.900 | (4.368) | (4.680) | 312 | (0,08) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | BPS | 3.200 | (2.026) | (2.152) | 126 | (0,04) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | BRC | 800 | (505) | (509) | 4 | (0,01) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | 3.400 | (2.153) | (2.278) | 125 | (0,04) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2017 | DUB | 25.650 | (14.405) | (3.897) | (10.508) | (0,25) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2018 | DUB | 4.000 | (2.375) | (437) | (1.938) | (0,04) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2018 | GST | 3.000 | (1.782) | (356) | (1.426) | (0,03) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2018 | GST | 800 | (480) | (121) | (359) | (0,01) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 2.500 | (1.583) | (1.656) | 73 | (0,03) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2017 | HUS | 6.305 | (3.541) | (1.016) | (2.525) | (0,06) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | HUS | 4.600 | (2.902) | (2.765) | (137) | (0,05) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | HUS | 3.500 | (2.216) | (2.356) | 140 | (0,04) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | JPM | 4.631 | (2.921) | (2.570) | (351) | (0,05) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 5.900 | (3.735) | (3.949) | 214 | (0,07) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | € 6.100 | (161) | (345) | 184 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 8.700 | (230) | (550) | 320 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 9.900 | (262) | (711) | 449 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 1.800 | (48) | (96) | 48 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 5.800 | (153) | (358) | 205 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 3.500 | (93) | (390) | 297 | 0,00 |
| | | | | | $ (120.790) | $ (71.135) | $ (49.655) | (2,12) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 3.696 | AUD | 5.084 | BOA | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 30.218 | | 41.580 | CBK | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 34 | $ | 25 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 46.664 | | 33.799 | UAG | 0 | (152) | (152) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 59.503 | BRL | 233.164 | DUB | 0 | (568) | (568) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 233.164 | $ | 61.733 | DUB | 2.797 | 0 | 2.797 | 0,05 |
| 01/2016 | CAD | 569 | | 427 | JPM | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 24.830 | | 24.184 | BOA | 0 | (621) | (621) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 25.140 | CHF | 24.830 | JPM | 0 | (334) | (334) | (0,01) |
| 01/2016 | | 397 | € | 365 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 767.439 | $ | 818.232 | BOA | 0 | (15.437) | (15.437) | (0,27) |
| 01/2016 | $ | 7.732 | € | 7.220 | BPS | 111 | 0 | 111 | 0,00 |
| 01/2016 | | 28.884 | | 26.696 | CBK | 121 | (6) | 115 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.923 | $ | 4.181 | GLM | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 779.432 | € | 709.255 | HUS | 0 | (8.968) | (8.968) | (0,16) |
| 01/2016 | | 25.325 | | 23.233 | JPM | 109 | (196) | (87) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.259 | | 1.154 | RBC | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.919 | | 5.595 | UAG | 159 | 0 | 159 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.005 | $ | 1.523 | BOA | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12 | £ | 8 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.788 | | 4.441 | BPS | 0 | (243) | (243) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 339.553 | $ | 510.999 | BPS | $ 10.531 | $ 0 | $ 10.531 | 0,18 |
| 01/2016 | | 5.116 | | 7.697 | JPM | 156 | 0 | 156 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 505.190 | £ | 341.233 | MSB | 0 | (2.247) | (2.247) | (0,04) |
| 01/2016 | | 162 | | 109 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 61.611 | JPY | 7.543.300 | FBF | 1.096 | 0 | 1.096 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY | 21.453.400 | $ | 175.632 | GLM | 0 | (2.708) | (2.708) | (0,05) |
| 01/2016 | | 94.600 | | 770 | JPM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 112.975 | JPY | 13.669.700 | MSB | 660 | 0 | 660 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 45.000 | $ | 366 | UAG | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.099 | JPY | 380.000 | UAG | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| 01/2016 | | 38 | KRW | 43.049 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 39.508.523 | $ | 33.977 | FBF | 375 | 0 | 375 | 0,01 |
| 01/2016 | MYR | 129.513 | | 29.911 | BPS | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 41.580 | | 30.177 | CBK | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 233.164 | | 58.923 | DUB | 586 | 0 | 586 | 0,01 |
| 02/2016 | CHF | 24.830 | | 25.170 | JPM | 334 | 0 | 334 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 4.938 | € | 4.514 | CBK | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 709.255 | $ | 779.984 | HUS | 8.974 | 0 | 8.974 | 0,16 |
| 02/2016 | $ | 1.094 | € | 1.004 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 341.233 | $ | 505.223 | MSB | 2.240 | 0 | 2.240 | 0,04 |
| 02/2016 | INR | 262.128 | | 3.930 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 13.669.700 | | 113.039 | MSB | 0 | (668) | (668) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 45.882 | | 32.590 | SCX | 304 | 0 | 304 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 1.169.092 | | 32.565 | BOA | 122 | 0 | 122 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 1.064.981 | | 32.596 | GLM | 325 | 0 | 325 | 0,01 |
| 03/2016 | MXN | 557.649 | | 31.984 | SOG | 0 | (143) | (143) | 0,00 |
| 05/2016 | $ | 1.468 | PLN | 5.827 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 05/2016 | | 568 | ZAR | 8.525 | BOA | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 71.658 | $ | 11.046 | JPM | 452 | 0 | 452 | 0,01 |
| 10/2016 | | 370.422 | | 57.257 | SCX | 2.495 | 0 | 2.495 | 0,04 |
| | | | | | | $ 32.108 | $ (32.612) | $ (504) | (0,01) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (120.758)** | **(2,12)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 5.711.029** | **100,02** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 147 | $ 107 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1.027 | 1.514 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 281 | 281 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 7.142 | 59 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7.798 | 7.798 | 0,14 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5 | 8 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 70 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 36 | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 85 | 85 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 3 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.432 | 2.432 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 8 | 8 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 4 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 16 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.343 | 2.343 | 0,04 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 86 | 63 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 1 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 14 | 10 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 3.878 | $ | 4.213 | 0,07 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 324 | | 478 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 3.008 | | 25 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 55 | | 55 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **19.499** | **0,34** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **(20.584)** | **(0,36)** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **5.709.944** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 181.142 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(d) Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

**(e) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 19.234 und Barmittel in Höhe von USD 108.575 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 12.171 und Barmittel von USD 3.558 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 15.247 und Barmittel in Höhe von USD 2.395 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(i) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 99.269 | $ 5.723.097 | $ 11.353 | $ 5.833.719 |
| Finanzderivate[3] | (1.721) | (120.969) | 0 | (122.690) |
| **Summen** | **$ 97.548** | **$ 5.602.128** | **$ 11.353** | **$ 5.711.029** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 546.029 | $ 7.552.369 | $ 30.554 | $ 8.128.952 |
| Finanzderivate[3] | 21.453 | 69.671 | 0 | 91.124 |
| **Summen** | **$ 567.482** | **$ 7.622.040** | **$ 30.554** | **$ 8.220.076** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class M Retail AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 4.516 | $ | 3.239 | AZD | $ 0 | $ (47) | $ (47) | 0,00 |
| 01/2016 | | 93 | | 68 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 523 | AUD | 727 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 295 | $ | 215 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.281 | | 3.829 | CBK | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 0 | AUD | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.354 | | 4.645 | GLM | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 4.528 | $ | 3.292 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.382 | AUD | 4.701 | NAB | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 01/2016 | | 25 | | 34 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 46 | $ | 33 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.896 | AUD | 4.028 | SCX | 34 | 0 | 34 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD 1.854 | $ 1.353 | SOG | $ 4 | $ 0 | $ 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 3.436 | AUD 4.744 | UAG | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 2.614 | $ 1.889 | UAG | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | $ 3.235 | AUD 4.516 | AZD | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD 8 | $ 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 3.286 | AUD 4.528 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | 3.287 | 4.528 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | 1.351 | 1.854 | SOG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.690 | 2.340 | UAG | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | $ 187 | $ (81) | $ 106 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CAD 8.798 | $ 6.339 | BOA | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| 01/2016 | 2.158 | 1.559 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | 492 | 354 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 7.780 | 5.599 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 6.998 | CAD 9.350 | HUS | 0 | (267) | (267) | 0,00 |
| 01/2016 | 7.023 | 9.358 | JPM | 0 | (286) | (286) | (0,01) |
| 01/2016 | 7.024 | 9.350 | MSB | 0 | (293) | (293) | (0,01) |
| 01/2016 | CAD 8.668 | $ 6.225 | MSB | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 5.992 | CAD 8.008 | SCX | 0 | (227) | (227) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD 8.661 | $ 6.251 | SOG | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 6.237 | CAD 8.661 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 5.599 | 7.780 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | 6.226 | 8.668 | MSB | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 02/2016 | 6.251 | 8.661 | SOG | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | | | | $ 43 | $ (1.108) | $ (1.065) | (0,02) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 2.697 | CHF 2.767 | BOA | $ 68 | $ 0 | $ 68 | 0,00 |
| 01/2016 | 981 | 996 | BPS | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 310 | $ 310 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.346 | 4.396 | CBK | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| 01/2016 | 18 | 18 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.258 | CHF 4.347 | DUB | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 110 | $ 107 | FBF | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 4.280 | 4.333 | JPM | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.256 | CHF 4.347 | JPM | 87 | 0 | 87 | 0,01 |
| 01/2016 | 70 | 69 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 3.917 | $ 3.954 | MSB | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.289 | CHF 4.355 | UAG | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 4.280 | $ 4.333 | UAG | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 4.320 | CHF 4.265 | CBK | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| 02/2016 | 4.339 | 4.280 | JPM | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| 02/2016 | 3.939 | 3.897 | MSB | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| 02/2016 | 4.338 | 4.280 | UAG | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | | | | $ 527 | $ (213) | $ 314 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 630.486 | $ 692.603 | BOA | $ 7.822 | $ (116) | $ 7.706 | 0,14 |
| 01/2016 | $ 693.750 | € 650.685 | BOA | 13.089 | 0 | 13.089 | 0,23 |
| 01/2016 | € 3.931 | $ 4.305 | BPS | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | 23.207 | 25.209 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 56.478 | 61.140 | CBK | 227 | (439) | (212) | (0,01) |
| 01/2016 | 1.986 | 2.124 | DUB | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 433.752 | € 409.364 | GLM | 10.941 | 0 | 10.941 | 0,19 |
| 01/2016 | 695.035 | 652.202 | HUS | 13.452 | 0 | 13.452 | 0,23 |
| 01/2016 | € 625.747 | $ 687.661 | HUS | 7.912 | 0 | 7.912 | 0,14 |
| 01/2016 | 410.591 | 448.681 | JPM | 2.655 | 0 | 2.655 | 0,05 |
| 01/2016 | 1.229 | 1.307 | NAB | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | 24.655 | 26.788 | RBC | 6 | (1) | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 31 | € 29 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 701 | $ 768 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 690.635 | € 649.878 | UAG | 15.327 | 0 | 15.327 | 0,27 |
| 01/2016 | € 640.906 | $ 699.747 | UAG | 3.778 | (247) | 3.531 | 0,07 |
| 02/2016 | $ 688.059 | € 625.747 | BOA | 0 | (7.828) | (7.828) | (0,14) |
| 02/2016 | € 3.961 | $ 4.351 | BOA | 46 | 0 | 46 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ 688.148 | € 625.747 | HUS | $ 0 | $ (7.918) | $ (7.918) | (0,14) |
| 02/2016 | 448.988 | 410.591 | JPM | 0 | (2.646) | (2.646) | (0,05) |
| 02/2016 | € 29 | $ 31 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 685.784 | € 627.393 | UAG | 0 | (364) | (3.764) | (0,07) |
| | | | | $ 75.295 | $ (23.021) | $ 52.274 | 0,91 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 374 | $ 562 | AZD | $ 10 | $ 0 | $ 10 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 235 | £ 156 | BOA | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 853 | $ 1.266 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 442.289 | £ 293.895 | BPS | 0 | (9.117) | (9.117) | (0,16) |
| 01/2016 | 446.312 | 295.417 | CBK | 0 | (10.897) | (10.897) | (0,19) |
| 01/2016 | £ 291.942 | $ 433.253 | CBK | 2.960 | 0 | 2.960 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 442.144 | £ 293.295 | DUB | 0 | (9.856) | (9.856) | (0,17) |
| 01/2016 | £ 11 | $ 16 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 65.313 | £ 43.416 | HUS | 0 | (1.322) | (1.322) | (0,02) |
| 01/2016 | £ 289.945 | $ 430.271 | JPM | 2.921 | 0 | 2.921 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 442.936 | £ 293.793 | MSB | 0 | (9.914) | (9.914) | (0,18) |
| 01/2016 | £ 289.945 | $ 429.259 | MSB | 1.909 | 0 | 1.909 | 0,03 |
| 01/2016 | 20.326 | 29.957 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 264.998 | 392.191 | SCX | 1.610 | 0 | 1.610 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 146 | £ 98 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 85.473 | $ 130.344 | UAG | 4.366 | 0 | 4.366 | 0,08 |
| 02/2016 | $ 428.888 | £ 288.990 | CBK | 0 | (2.912) | (2.912) | (0,05) |
| 02/2016 | 430.288 | 289.945 | JPM | 0 | (2.904) | (2.904) | (0,05) |
| 02/2016 | 429.287 | 289.945 | MSB | 0 | (1.903) | (1.903) | (0,03) |
| 02/2016 | 392.220 | 264.998 | SCX | 0 | (1.609) | (1.609) | (0,03) |
| 02/2016 | £ 151 | $ 226 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | $ 13.788 | $ (50.443) | $ (36.655) | (0,64) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 15.513 | SEK 135.285 | BOA | $ 534 | $ 0 | $ 534 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 132.877 | $ 15.914 | BOA | 153 | 0 | 153 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 15.459 | SEK 135.294 | BPS | 589 | 0 | 589 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 9.308 | $ 1.104 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 135.677 | 16.262 | CBK | 177 | (9) | 168 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 15.582 | SEK 135.500 | CBK | 490 | 0 | 490 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 132.878 | $ 15.872 | JPM | 111 | 0 | 111 | 0,00 |
| 01/2016 | 120.532 | 14.380 | MSB | 83 | 0 | 83 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 13.289 | SEK 115.886 | SCX | 457 | 0 | 457 | 0,01 |
| 02/2016 | 15.927 | 132.877 | BOA | 0 | (152) | (152) | 0,00 |
| 02/2016 | 15.951 | 132.877 | CBK | 0 | (176) | (176) | 0,00 |
| 02/2016 | 15.885 | 132.878 | JPM | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| 02/2016 | 14.392 | 120.532 | MSB | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | | | | $ 2.594 | $ (530) | $ 2.064 | 0,04 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 52 | $ 37 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 6 | 4 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 94 | 67 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 307 | SGD 436 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 591 | 834 | HUS | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | 595 | 837 | SCX | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ (11) | $ (10) | 0,00 |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 160.377 | $ 175.028 | $ (669) | $ 0 | $ (669) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbind-lichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (2,500 %) | 24.09.2015 | 23.09.2017 | € 590 | $ (636) | (0,02) |
| BRC | 0,100 % | 16.12.2015 | 15.12.2017 | $ 16.840 | (16.841) | (0,29) |
| CFR | (1,750 %) | 06.05.2015 | 05.05.2017 | 4.643 | (4.581) | (0,08) |
| CFR | (1,750 %) | 10.06.2015 | 09.06.2017 | 650 | (642) | (0,01) |
| DEU | 0,500 % | 15.12.2015 | 18.12.2017 | 3.835 | (3.836) | (0,07) |
| MYI | (0,080 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | € 70.954 | (77.067) | (1,35) |
| MYI | (0,060 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 66.782 | (72.539) | (1,27) |
| RCE | (0,600 %) | 24.12.2015 | 22.12.2017 | 4.252 | (4.618) | (0,08) |
| | | | | | $ (180.760) | (3,17) |

**(m) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 10 | $ 0 | $ 10 |
| BOA | (12.833) | 13.958 | 1.125 |
| BPS | (1.543) | 1.811 | 268 |
| BRC | (16.885) | 17.069 | 184 |
| CBK | (32.405) | 29.888 | (2.517) |
| DUB | (26.946) | 14.959 | (11.987) |
| FBF | (869) | 1.121 | 252 |
| GLM | 7.835 | (17.520) | (9.685) |
| GST | (10.901) | 11.082 | 181 |
| HUS | (803) | (2.990) | (3.793) |
| JPM | (15.190) | 15.227 | 37 |
| MSB | (10.217) | 7.582 | (2.635) |
| MYC | (4.808) | 4.902 | 94 |
| NAB | 10 | 0 | 10 |
| RBC | (3) | 0 | (3) |
| RYL | (571) | 570 | (1) |
| SCX | 3.064 | (3.080) | (16) |
| SOG | (423) | 430 | (7) |
| UAG | 19.079 | (22.840) | (3.761) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(n) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 102,17 | 108,63 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,03) | 0,29 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,00 | 0,06 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (2,12) | 0,87 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Diversified Income Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 165.200 | $ | 230.135 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 59.500 | | 79.376 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 61.100 | | 75.321 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | $ | 58.900 | | 61.832 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 59.500 | | 59.701 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 55.000 | | 58.310 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 56.225 | | 56.310 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 54.700 | | 56.112 |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 55.100 | | 55.175 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 52.725 | | 53.569 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 52.127 | | 52.282 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 47.800 | | 50.892 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | |
| 7,721 % fällig am 04.06.2038 | $ | 42.752 | | 48.944 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 48.100 | | 47.015 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 0,040 % fällig am 08.07.2015 | | 45.800 | | 45.799 |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.03.2022 | | 40.750 | | 43.255 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 34.265 | | 40.056 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | $ | 39.100 | | 39.488 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 33.000 | | 37.529 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 32.600 | | 36.609 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | | 30.900 | | 36.241 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 23.500 | | 35.318 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | $ | 27.200 | | 34.850 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 33.900 | | 34.683 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | | 33.000 | | 33.737 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 44.808.136 | $ | 448.400 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 165.200 | | 225.639 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 116.266 | | 131.533 |
| **H.J. Heinz Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.06.2020 | | 120.944 | | 120.944 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | £ | 58.500 | | 96.511 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 64.500 | | 84.795 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | $ | 69.200 | | 81.748 |
| **Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.** | | | | |
| 5,298 % fällig am 27.12.2017 | | 75.200 | | 68.783 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 59.500 | | 59.691 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | € | 51.130 | | 59.689 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | $ | 54.700 | | 55.631 |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 30.03.2040 | | 48.000 | | 54.016 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.06.2019 | £ | 30.950 | | 52.496 |
| **Dell, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2020 | $ | 52.259 | | 52.414 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.09.2041 | € | 37.700 | | 51.533 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | $ | 46.750 | | 47.414 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | € | 37.200 | | 46.153 |
| **GTL Trade Finance, Inc.** | | | | |
| 5,893 % fällig am 29.04.2024 | $ | 53.752 | | 45.510 |
| **VimpelCom Holdings BV** | | | | |
| 7,504 % fällig am 01.03.2022 | | 49.550 | | 44.843 |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 42.600 | | 44.783 |

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Duration Hedged Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.06.2019 | $ | 2.288 | $ 1.718 | 0,16 |
| **Virgin Australia 2013-1B Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 23.10.2020 | | 408 | 414 | 0,04 |
| | | | 2.132 | 0,20 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **Heta Asset Resolution AG (a)** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.05.2016 | CHF | 5.100 | 3.388 | 0,32 |
| 4,250 % fällig am 31.10.2016 | € | 4.900 | 3.620 | 0,34 |
| 4,375 % fällig am 24.01.2017 | | 8.200 | 6.057 | 0,58 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.07.2017 | $ | 7.200 | 7.515 | 0,71 |
| | | | 20.580 | 1,95 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 10.000 | 10.926 | 1,04 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **Weatherford International Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2038 | | 900 | 629 | 0,06 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 6.690 | 5.118 | 0,48 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico eSocial** | | | | |
| 3,625 % fällig am 21.01.2019 | € | 1.500 | 1.460 | 0,14 |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | $ | 18.800 | 18.565 | 1,76 |
| 6,500 % fällig am 10.06.2019 | | 2.600 | 2.555 | 0,24 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2016 | | 4.700 | 4.702 | 0,45 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 14.600 | 2.640 | 0,25 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | $ | 16.400 | 12.259 | 1,16 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 1.800 | 1.296 | 0,12 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 1.200 | 783 | 0,07 |
| | | | 49.378 | 4,67 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 6.600 | 4.950 | 0,47 |
| **KANADA** | | | | |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | | 560 | 434 | 0,04 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.08.2020 | | 700 | 673 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 596 | 575 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 6.600 | 6.259 | 0,59 |
| | | | 7.941 | 0,75 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | $ | 943 | 942 | 0,09 |
| **Lima Metro Line 2 Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 1.300 | 1.268 | 0,12 |
| **Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 10.048 | 3.718 | 0,35 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 184 | 42 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 714 | 171 | 0,02 |
| **UPCB Finance IV Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 1.100 | 1.129 | 0,11 |
| | | | 7.270 | 0,69 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | $ | 7.000 | $ 6.988 | 0,66 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 3.300 | 2.655 | 0,25 |
| | | | 9.643 | 0,91 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 9.200 | 7.728 | 0,73 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | | 1.200 | 1.005 | 0,09 |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 1.100 | 925 | 0,09 |
| | | | 1.930 | 0,18 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 1.700 | 1.611 | 0,15 |
| 7,450 % fällig am 30.04.2044 | | 800 | 810 | 0,08 |
| | | | 2.421 | 0,23 |
| **EL SALVADOR** | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 1.800 | 1.532 | 0,15 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 400 | 343 | 0,03 |
| | | | 1.875 | 0,18 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **AXA S.A.** | | | | |
| 5,453 % fällig am 29.11.2049 | £ | 1.600 | 2.370 | 0,22 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 900 | 925 | 0,09 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | | 5.400 | 5.263 | 0,50 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 2.300 | 2.422 | 0,23 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.09.2041 | £ | 1.200 | 1.981 | 0,19 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 4.700 | 4.862 | 0,46 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 3.100 | 3.468 | 0,33 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 1.900 | 1.949 | 0,18 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 5.000 | 5.530 | 0,52 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2025 | € | 700 | 715 | 0,07 |
| **La Mondiale SAM** | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | | 2.500 | 2.745 | 0,26 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | $ | 200 | 199 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 7.500 | 8.280 | 0,78 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | | 3.700 | 4.018 | 0,38 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.04.2025 | $ | 2.900 | 2.742 | 0,26 |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | | 3.300 | 3.368 | 0,32 |
| **Solvay Finance S.A.** | | | | |
| 5,869 % fällig am 29.12.2049 | € | 300 | 325 | 0,03 |
| | | | 51.162 | 4,84 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2022 | | 630 | 727 | 0,07 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | | 100 | 105 | 0,01 |
| | | | 832 | 0,08 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 502.000 | 3.756 | 0,35 |
| 4,500 % fällig am 08.11.2016 | | 730.000 | 5.765 | 0,55 |
| 4,500 % fällig am 03.07.2017 | | 250.000 | 1.912 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 183.000 | $ 1.468 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 12.000 | 96 | 0,01 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | | 109.300 | 836 | 0,08 |
| | | | 13.833 | 1,31 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 ClassA Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | $ | 3.628 | 3.716 | 0,35 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | € | 3.500 | 3.596 | 0,34 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | $ | 8.000 | 7.252 | 0,69 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 7.700 | 8.272 | 0,78 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2021 | | 7.300 | 7.455 | 0,71 |
| | | | 26.575 | 2,52 |
| **IRLAND** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 700 | 718 | 0,07 |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 4.700 | 5.154 | 0,49 |
| **Borets Finance Ltd.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 26.09.2018 | | 11.100 | 9.135 | 0,86 |
| **Brunswick Rail Finance Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2017 | | 4.500 | 2.048 | 0,19 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 3,424 % fällig am 27.02.2021 | | 3.439 | 3.411 | 0,32 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.** | | | | |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | | 4.700 | 4.723 | 0,45 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO US Short-Term Fund (c) | | 2.596.251 | 25.963 | 2,46 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Rosneft Oil Co. via Rosneft International Finance Ltd.** | | | | |
| 3,149 % fällig am 06.03.2017 | $ | 1.000 | 986 | 0,09 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 5,700 % fällig am 05.04.2022 | | 2.000 | 1.962 | 0,19 |
| | | | 54.100 | 5,12 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | € | 700 | 764 | 0,07 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.07.2020 | | 500 | 544 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 400 | 446 | 0,04 |
| **Finmeccanica SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 7.700 | 13.270 | 1,26 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 3.100 | 3.055 | 0,29 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 5.600 | 6.359 | 0,60 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 (b) | € | 8.600 | 11.090 | 1,05 |
| | | | 35.528 | 3,36 |
| **JAPAN** | | | | |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.07.2025 | | 1.300 | 1.374 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 30.07.2027 | | 500 | 529 | 0,05 |
| | | | 1.903 | 0,18 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 2.200 | 2.176 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 1.100 | 1.086 | 0,10 |
| **Zhaikmunai LLP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 14.02.2019 | | 4.100 | 3.228 | 0,31 |
| | | | 6.490 | 0,62 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 4.700 | $ | 5.106 | 0,48 |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 300 | | 297 | 0,03 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 2.200 | | 2.082 | 0,20 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | | |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 300 | | 303 | 0,03 |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 2.800 | | 3.024 | 0,29 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.06.2019 | | 200 | | 190 | 0,02 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | | 5.100 | | 5.247 | 0,50 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 600 | | 641 | 0,06 |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | $ | 1.300 | | 1.310 | 0,12 |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | | 2.400 | | 2.445 | 0,23 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 700 | | 692 | 0,06 |
| **Severstal OAO Via Steel Capital S.A.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 19.03.2018 | | 300 | | 300 | 0,03 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | | 2.000 | | 1.920 | 0,18 |
| 7,721 % fällig am 04.06.2038 | | 2.700 | | 2.828 | 0,27 |
| **Telenet Finance V Luxembourg S.C.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.08.2022 | € | 800 | | 940 | 0,09 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | | 7.200 | | 7.821 | 0,74 |
| | | | | 35.146 | 3,33 |
| **MARSHALLINSELN** | | | | | |
| **Seadrill Operating LP** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.02.2021 | $ | 528 | | 218 | 0,02 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 11.360 | | 11.374 | 1,08 |
| **Cemex SAB de C.V.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.03.2023 | € | 5.400 | | 5.340 | 0,50 |
| 5,071 % fällig am 15.10.2018 | $ | 300 | | 294 | 0,03 |
| 9,500 % fällig am 15.06.2018 | | 500 | | 535 | 0,05 |
| **Desarrolladora Homex SAB de C.V.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 28.09.2015 (a) | | 120 | | 2 | 0,00 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 3.300 | | 3.003 | 0,28 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | $ | 2.100 | | 1.866 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 7.600 | | 6.943 | 0,66 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 2.400 | | 1.921 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | $ | 1.700 | | 1.478 | 0,14 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 10.000 | | 8.988 | 0,85 |
| | | | | 41.744 | 3,95 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 7.500 | | 9.716 | 0,92 |
| **ING Bank NV** | | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 8.600 | | 9.358 | 0,89 |
| **NN Group NV** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | € | 3.800 | | 4.070 | 0,38 |
| **RWE Finance BV** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 1.200 | | 2.006 | 0,19 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 6.000 | | 6.355 | 0,60 |
| **Schaeffler Holding Finance BV** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 (d) | $ | 500 | | 540 | 0,05 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2019 | £ | 200 | | 292 | 0,03 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2018 | $ | 200 | | 192 | 0,02 |
| **Ziggo BV** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2022 | € | 5.764 | | 6.134 | 0,58 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2022 | | 5.236 | | 5.572 | 0,53 |
| | | | | 44.235 | 4,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **PANAMA** | | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | | |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | $ | 3.700 | $ | 4.412 | 0,42 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 100 | | 131 | 0,01 |
| | | | | 4.543 | 0,43 |
| **PORTUGAL** | | | | | |
| **Novo Banco S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | € | 700 | | 662 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 4.800 | | 4.582 | 0,43 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 2.000 | | 1.905 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 1.700 | | 1.653 | 0,16 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 1.482 | | 1.457 | 0,14 |
| | | | | 10.259 | 0,97 |
| **RUMÄNIEN** | | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 28.10.2024 | | 2.400 | | 2.699 | 0,25 |
| 3,625 % fällig am 24.04.2024 | | 1.300 | | 1.548 | 0,15 |
| | | | | 4.247 | 0,40 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 700 | | 804 | 0,08 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.200 | | 2.351 | 0,22 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 1.400 | | 1.504 | 0,14 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | € | 3.000 | | 3.072 | 0,29 |
| **Spain Government Bond** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 (b) | | 8.900 | | 10.555 | 1,00 |
| | | | | 18.286 | 1,73 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 10.500 | | 11.338 | 1,07 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.400 | | 1.476 | 0,14 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 14.600 | | 15.275 | 1,44 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 900 | | 1.028 | 0,10 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 4.900 | | 5.145 | 0,49 |
| | | | | 34.262 | 3,24 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 2.700 | | 3.080 | 0,29 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 5.400 | | 10.284 | 0,97 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 2.100 | | 4.009 | 0,38 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 1.600 | | 2.363 | 0,22 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 7.400 | | 11.907 | 1,13 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 1.500 | | 2.426 | 0,23 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 3.400 | | 5.343 | 0,51 |
| **HBOS PLC** | | | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | € | 1.000 | | 1.252 | 0,12 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 1.000 | | 1.073 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 600 | | 658 | 0,06 |
| **Ineos Finance PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2023 | | 300 | | 312 | 0,03 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 4.100 | | 6.380 | 0,60 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 2.940 | | 5.898 | 0,56 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 826 | | 1.278 | 0,12 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 1,033 % fällig am 15.12.2030 | | 2.537 | | 3.363 | 0,32 |
| **Premier Foods Finance PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | | 141 | 0,01 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | $ | 2.000 | | 2.221 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 400 | $ | 417 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 200 | | 212 | 0,02 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | | |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | £ | 2.800 | | 4.323 | 0,41 |
| **SSE PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | $ | 1.400 | | 1.461 | 0,14 |
| **Stonegate Pub Co. Financing PLC** | | | | | |
| 5,329 % fällig am 15.04.2019 | £ | 500 | | 739 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2019 | | 200 | | 301 | 0,03 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 3.210 | | 4.459 | 0,42 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 3.679 | | 4.614 | 0,44 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 823 | | 1.269 | 0,12 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 3.000 | | 4.070 | 0,39 |
| | | | | 83.853 | 7,94 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2025 | | 400 | | 562 | 0,05 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | $ | 489 | | 490 | 0,05 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | | |
| **Albertson's LLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 25.08.2019 | | 1.444 | | 1.432 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2021 | | 3.970 | | 3.943 | 0,37 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | | 148 | | 146 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 04.01.2021 | | 544 | | 535 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 24.01.2023 | | 700 | | 699 | 0,07 |
| **Commscope, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.12.2022 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| 3,828 % fällig am 29.12.2022 | | 199 | | 198 | 0,02 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 2.472 | | 2.456 | 0,23 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 2.078 | | 2.074 | 0,20 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.10.2018 | | 1.454 | | 1.451 | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 12.533 | | 12.473 | 1,18 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 1.683 | | 1.683 | 0,16 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 2.538 | | 2.536 | 0,24 |
| **Las Vegas Sands LLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 832 | | 823 | 0,08 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.12.2019 | | 1.485 | | 1.468 | 0,14 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 1.683 | | 1.644 | 0,16 |
| **Numericable US LLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.05.2020 | | 1.782 | | 1.722 | 0,16 |
| **Texas Competitive Electric Holdings Co. LLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.11.2016 | | 1.431 | | 1.424 | 0,13 |
| | | | | 36.708 | 3,47 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ADT Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2042 | | 1.860 | | 1.339 | 0,13 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.02.2018 | | 2.300 | | 2.294 | 0,22 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 2.400 | | 2.406 | 0,23 |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 700 | | 692 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 7.000 | | 6.982 | 0,66 |
| 4,750 % fällig am 10.09.2018 | | 2.300 | | 2.360 | 0,22 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | | |
| 10,200 % fällig am 06.02.2039 | | 1.100 | | 1.809 | 0,17 |
| **AT & T, Inc.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 900 | | 867 | 0,08 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Aviation Loan Trust 2013-2** | | | |
| 2,622 % fällig am 15.09.2021 | $ 152 | $ 141 | 0,01 |
| **Bruce Mansfield Unit 1 2007 Pass-Through Trust** | | | |
| 6,850 % fällig am 01.06.2034 | 4.204 | 4.229 | 0,40 |
| **California Resources Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 (b) | 538 | 194 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | 644 | 206 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | 334 | 103 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | 2.985 | 1.578 | 0,15 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | 300 | 313 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | 7.150 | 7.860 | 0,74 |
| **CCO Safari II LLC** | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | 1.600 | 1.596 | 0,15 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | 800 | 810 | 0,08 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | 10.800 | 3.051 | 0,29 |
| **CIT Group, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | 9.800 | 10.143 | 0,96 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | 500 | 489 | 0,05 |
| **Consol Energy, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2022 | 2.200 | 1.375 | 0,13 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2022 | 600 | 443 | 0,04 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | 2.750 | 2.729 | 0,26 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | 2.250 | 2.008 | 0,19 |
| **Doctors Co.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | 1.800 | 1.935 | 0,18 |
| **Endo Finance LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2023 | 1.200 | 1.182 | 0,11 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | 1.500 | 1.529 | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | 900 | 926 | 0,09 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | 2.000 | 2.442 | 0,23 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | 1.000 | 998 | 0,09 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | |
| 5,450 % fällig am 15.03.2043 | 300 | 157 | 0,02 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 3,450 % fällig am 10.04.2022 | 2.900 | 2.786 | 0,26 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | 6.500 | 6.556 | 0,62 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | 500 | 511 | 0,05 |
| **Hartford HealthCare Corp.** | | | |
| 5,746 % fällig am 01.04.2044 | 2.000 | 2.171 | 0,21 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | 4.150 | 4.119 | 0,39 |
| **iStar, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.11.2017 | 1.500 | 1.474 | 0,14 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | 800 | 707 | 0,07 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2037 | 2.600 | 2.239 | 0,21 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | 300 | 258 | 0,02 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.01.2032 | 300 | 286 | 0,03 |
| 7,800 % fällig am 01.08.2031 | 4.100 | 3.855 | 0,36 |
| **Meccanica Holdings USA, Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.01.2040 | 200 | 186 | 0,02 |
| **MetLife, Inc.** | | | |
| 10,750 % fällig am 01.08.2039 | 200 | 314 | 0,03 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | 7.400 | 6.937 | 0,66 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | 6.600 | 6.810 | 0,64 |
| **MPLX LP** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 | 500 | 450 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 01.12.2024 | 3.250 | 2.933 | 0,28 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2025 | 3.750 | 3.375 | 0,32 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 17.06.2019 | 6.200 | 5.720 | 0,54 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 5.000 | 4.953 | 0,47 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | 15.400 | 16.247 | 1,54 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | |
| 7,625 % fällig am 15.01.2018 | $ 8.300 | $ 8.694 | 0,82 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2019 | 400 | 407 | 0,04 |
| **PHH Corp.** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | 5.800 | 5.307 | 0,50 |
| **QVC, Inc.** | | | |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | 2.700 | 2.342 | 0,22 |
| 5,950 % fällig am 15.03.2043 | 1.600 | 1.361 | 0,13 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | 4.600 | 4.081 | 0,39 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 5.550 | 4.114 | 0,39 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | 8.140 | 7.530 | 0,71 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | 2.400 | 2.292 | 0,22 |
| 6,850 % fällig am 15.07.2018 | 9.700 | 9.555 | 0,90 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 2.200 | 2.035 | 0,19 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | 600 | 530 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | 8.700 | 7.395 | 0,70 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | 2.700 | 2.363 | 0,22 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | |
| 7,500 % fällig am 30.11.2016 | 1.100 | 1.100 | 0,10 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | |
| 4,450 % fällig am 03.12.2025 | 200 | 198 | 0,02 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | 2.600 | 2.698 | 0,26 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | 1.900 | 1.380 | 0,13 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 300 | 227 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 14.400 | 10.850 | 1,03 |
| **Terraform Global Operating LLC** | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | 3.300 | 2.648 | 0,25 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | 200 | 195 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 15.10.2021 | 1.900 | 1.815 | 0,17 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | 3.500 | 3.327 | 0,32 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | 300 | 302 | 0,03 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2023 | 8.183 | 8.306 | 0,79 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 4,672 % fällig am 15.03.2055 | 2.100 | 1.831 | 0,17 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 0,810 % fällig am 20.11.2017 | 300 | 288 | 0,03 |
| 1,650 % fällig am 22.05.2018 | 600 | 576 | 0,05 |
| **Williams Cos., Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.01.2031 | 600 | 416 | 0,04 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 700 | 529 | 0,05 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 8.500 | 7.608 | 0,72 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € 3.800 | 3.960 | 0,37 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | $ 500 | 491 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | 400 | 383 | 0,04 |
| | | 245.207 | 23,21 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **7 WTC Depositor LLC Trust** | | | |
| 4,082 % fällig am 13.03.2031 | 150 | 153 | 0,01 |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | |
| 1,202 % fällig am 25.10.2035 | 200 | 163 | 0,02 |
| 1,622 % fällig am 25.06.2035 | 700 | 603 | 0,06 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.02.2036 | 600 | 541 | 0,05 |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | 1.000 | 859 | 0,08 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,792 % fällig am 25.10.2035 | 3.021 | 2.985 | 0,28 |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.07.2036 (a) | 10 | 7 | 0,00 |
| 1,737 % fällig am 25.01.2036 | 39 | 36 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2018 | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | 323 | 277 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | 1.163 | 940 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | 514 | 453 | 0,04 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.11.2035 | $ 200 | $ 166 | 0,02 |
| 1,472 % fällig am 25.10.2033 | 92 | 88 | 0,01 |
| 3,797 % fällig am 25.11.2032 | 1.175 | 1.131 | 0,11 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | 740 | 268 | 0,03 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-ThroughCertificates** | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | 1.762 | 1.680 | 0,16 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.01.2037 (a) | 332 | 210 | 0,02 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,568 % fällig am 10.04.2049 | 953 | 982 | 0,09 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 0,922 % fällig am 26.06.2035 | 101 | 95 | 0,01 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,815 % fällig am 25.09.2034 | 517 | 508 | 0,05 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 1,083 % fällig am 26.11.2046 | 699 | 675 | 0,06 |
| 2,897 % fällig am 26.07.2036 | 275 | 276 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 26.04.2037 | 150 | 152 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,580 % fällig am 25.02.2036 | 70 | 61 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | 991 | 995 | 0,09 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 25.04.2035 | 267 | 258 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.02.2037 | 796 | 755 | 0,07 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 337 | 323 | 0,03 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2036 (a) | 350 | 329 | 0,03 |
| 0,842 % fällig am 25.12.2035 | 300 | 258 | 0,02 |
| 1,092 % fällig am 25.06.2035 | 1.000 | 890 | 0,08 |
| 2,222 % fällig am 25.07.2034 | 271 | 249 | 0,02 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.01.2037 | 470 | 342 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.05.2036 | 528 | 510 | 0,05 |
| 0,682 % fällig am 25.02.2037 | 1.000 | 719 | 0,07 |
| 1,472 % fällig am 25.05.2035 | 300 | 228 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.05.2037 | 58 | 57 | 0,01 |
| 1,352 % fällig am 25.05.2035 | 200 | 159 | 0,02 |
| 2,311 % fällig am 25.10.2046 (a) | 105 | 86 | 0,01 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2035 | 571 | 567 | 0,05 |
| **COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,766 % fällig am 15.05.2046 | 2.844 | 2.975 | 0,28 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | 248 | 239 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | 684 | 623 | 0,06 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | 1.713 | 1.598 | 0,15 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2036 | 100 | 89 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.06.2036 | 400 | 360 | 0,03 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2036 | 1.500 | 1.234 | 0,12 |
| 0,872 % fällig am 25.03.2036 | 100 | 74 | 0,01 |
| 0,882 % fällig am 25.05.2036 | 400 | 348 | 0,03 |
| 0,912 % fällig am 25.02.2036 | 200 | 164 | 0,02 |
| 0,942 % fällig am 25.12.2035 | 356 | 353 | 0,03 |
| 0,962 % fällig am 25.01.2036 | 467 | 457 | 0,04 |
| 0,982 % fällig am 25.04.2034 | 176 | 160 | 0,02 |
| 1,022 % fällig am 25.11.2033 | 804 | 769 | 0,07 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 618 | 590 | 0,06 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | 717 | 712 | 0,07 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.04.2046 (a) | 78 | 79 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 | 97 | 90 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 1,217 % fällig am 25.04.2046 (a) | 29 | 17 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 152 | 126 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 (a) | 319 | 288 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | |
| 2,370 % fällig am 26.04.2038 | 1.300 | 1.278 | 0,12 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.09.2037 | 509 | 458 | 0,04 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 0,428 % fällig am 27.02.2036 | 585 | 560 | 0,05 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | 500 | 490 | 0,05 |
| 1,697 % fällig am 25.07.2034 | 855 | 797 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,725 % fällig am 25.09.2035 | $ 77 | $ 74 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | 300 | 174 | 0,02 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 0,472 % fällig am 25.12.2046 | 42 | 23 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2046 | 59 | 53 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | 378 | 231 | 0,02 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | 1.243 | 964 | 0,09 |
| 1,157 % fällig am 25.09.2035 (a) | 368 | 328 | 0,03 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | 601 | 504 | 0,05 |
| 0,642 % fällig am 19.06.2035 | 17 | 15 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 20.10.2045 | 1.486 | 1.323 | 0,13 |
| 0,712 % fällig am 19.11.2035 | 23 | 19 | 0,00 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 1,517 % fällig am 25.05.2035 | 200 | 176 | 0,02 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | 212 | 183 | 0,02 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2047 | 172 | 125 | 0,01 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,302 % fällig am 25.06.2037 (a) | 35 | 27 | 0,00 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 1,052 % fällig am 25.02.2036 | 500 | 444 | 0,04 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 5,257 % fällig am 15.05.2047 | 2.416 | 2.454 | 0,23 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | 1.198 | 630 | 0,06 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | 427 | 414 | 0,04 |
| 0,682 % fällig am 25.07.2036 | 500 | 367 | 0,03 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | 500 | 402 | 0,04 |
| **LB Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,853 % fällig am 15.07.2044 | 2.997 | 3.108 | 0,29 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 (a) | 664 | 638 | 0,06 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | 363 | 323 | 0,03 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,802 % fällig am 25.08.2045 | 1.586 | 1.480 | 0,14 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,112 % fällig am 25.03.2035 | 1.400 | 1.222 | 0,12 |
| 1,172 % fällig am 25.12.2034 (a) | 114 | 109 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.01.2037 | 69 | 68 | 0,01 |
| 5,463 % fällig am 25.05.2036 | 22 | 20 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc.Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.05.2037 | 414 | 288 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.08.2035 | 3.000 | 2.917 | 0,28 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,862 % fällig am 25.03.2036 (a) | 116 | 95 | 0,01 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | 86 | 85 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 3,422 % fällig am 25.01.2033 (a) | 587 | 521 | 0,05 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative LoanTrust** | | | |
| 2,975 % fällig am 25.08.2035 | 17 | 17 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,912 % fällig am 25.05.2035 | 1.736 | 1.665 | 0,16 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | 444 | 260 | 0,02 |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | 1.000 | 846 | 0,08 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | 2.300 | 2.072 | 0,20 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-ThroughCertificates** | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | 1.000 | 940 | 0,09 |
| 1,472 % fällig am 25.09.2034 | 26 | 22 | 0,00 |
| 2,222 % fällig am 25.12.2034 | 473 | 401 | 0,04 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 0,952 % fällig am 25.12.2035 | 400 | 382 | 0,04 |
| 1,622 % fällig am 25.09.2047 | 558 | 549 | 0,05 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.05.2047 | $ 245 | $ 192 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2034 | 584 | 615 | 0,06 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | 232 | 215 | 0,02 |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | 660 | 647 | 0,06 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2035 | 226 | 219 | 0,02 |
| 0,882 % fällig am 25.11.2035 | 300 | 239 | 0,02 |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | 1.000 | 805 | 0,08 |
| 1,307 % fällig am 25.01.2034 | 252 | 227 | 0,02 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.02.2036 | 11 | 10 | 0,00 |
| 0,812 % fällig am 25.02.2036 | 1.279 | 1.217 | 0,12 |
| 1,042 % fällig am 25.05.2035 | 1.000 | 906 | 0,09 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 1,097 % fällig am 25.01.2035 | 172 | 159 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 | 942 | 897 | 0,08 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 1,247 % fällig am 25.05.2035 | 209 | 197 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.06.2037 | 872 | 760 | 0,07 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.03.2036 | 618 | 550 | 0,05 |
| 1,157 % fällig am 25.08.2035 | 1.200 | 1.163 | 0,11 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.05.2036 | 1.393 | 1.048 | 0,10 |
| 0,632 % fällig am 25.09.2047 (a) | 1.958 | 1.359 | 0,13 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage LoanTrust** | | | |
| 1,422 % fällig am 25.08.2037 | 1.159 | 1.075 | 0,10 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 5,654 % fällig am 25.03.2034 | 25 | 26 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.09.2035 | 400 | 304 | 0,03 |
| **Suntrust Alternative Loan Trust** | | | |
| 1,072 % fällig am 25.12.2035 (a) | 14 | 11 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,672 % fällig am 25.06.2037 (a) | 99 | 87 | 0,01 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.03.2036 | 3.467 | 3.159 | 0,30 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | 28 | 26 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | |
| 4,530 % fällig am 25.09.2036 (a) | 205 | 112 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,658 % fällig am 25.03.2035 | 345 | 347 | 0,03 |
| | | 78.496 | 7,43 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series2015** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | 1.200 | 1.269 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | 630 | 638 | 0,06 |
| **Erie, New York, Tobacco Asset Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2028 | 165 | 165 | 0,01 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 8,084 % fällig am 15.02.2050 | 1.300 | 1.919 | 0,18 |
| **Franklin, Ohio, Tobacco Settlement Financing Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2047 | 600 | 519 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 01.06.2042 | 200 | 177 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2047 | 300 | 279 | 0,03 |
| **Fulton, Georgia, Municipal Electric Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | 1.200 | 1.426 | 0,13 |
| **Richmond, Virginia, Tobacco Settlement Finance Corporation Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 6,706 % fällig am 01.06.2046 | 95 | 73 | 0,01 |
| **San Diego, California, Redevelopment Agency Tax Allocation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.09.2030 | $ 100 | $ 117 | 0,01 |
| | | 6.582 | 0,62 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,176 % fällig am 14.01.2016 (e) | 1.300 | 1.300 | 0,12 |
| 0,194 % fällig am 21.01.2016 (e) (f) | 13.300 | 13.299 | 1,26 |
| 0,219 % fällig am 07.01.2016 (e) | 30.301 | 30.301 | 2,87 |
| 0,561 % fällig am 30.06.2016 | 7.600 | 7.582 | 0,72 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 0,250 % fällig am 29.02.2016 | 9.800 | 9.800 | 0,93 |
| 0,375 % fällig am 31.01.2016 - 15.02.2016 (g) | 4.500 | 4.501 | 0,42 |
| | | 66.783 | 6,32 |
| Summe USA | | 434.266 | 41,10 |
| **URUGUAY** | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | 3.800 | 3.287 | 0,31 |
| **VENEZUELA** | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 | 4.150 | 1.515 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 | 15.000 | 5.482 | 0,52 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 | 4.000 | 1.610 | 0,15 |
| | | 8.607 | 0,82 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 2.623.129 | 26.237 | 2,48 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.071.294** | **101,40** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 350 | $ 907 | 0,09 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 18 | 49 | 0,00 |
| | | | | $ 956 | 0,09 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 956** | **0,09** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 70.300 | $ (265) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 15.06.2018 | $ 23.600 | $ 61 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | 120.200 | (550) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2019 | 121.800 | (1.483) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 69.300 | 341 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 37.700 | (989) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 26.100 | (482) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 62.500 | 210 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 29.600 | (1.847) | (0,17) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 46.500 | (175) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 18.03.2020 | 9.300 | (52) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 21.500 | (232) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | £ 30.000 | 24 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 10.300 | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (5.176) | (0,49) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (5.441)** | **(0,52)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | CNH 6,615 | 18.08.2016 | $ 9.048 | $ 192 | $ 282 | 0,03 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - iTraxx Europe Series 24 Index | BRC | Verkauf | 1,050 % | 20.01.2016 | € 7.900 | $ (18) | $ (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | $ 2.500 | (5) | (2) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 19.300 | (41) | (18) | 0,00 |
| | | | | | | $ (64) | $ (21) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,107 | 02.03.2016 | € 11.200 | $ (101) | $ (103) | (0,01) |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,023 | 02.03.2016 | 11.200 | (102) | (21) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | CNH 6,985 | 18.08.2016 | $ 9.048 | (109) | (113) | (0,01) |
| | | | | | $ (312) | $ (237) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | $ 1.700 | $ (281) | $ (222) | $ (59) | (0,03) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 200 | (140) | (19) | (121) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 100 | (70) | (10) | (60) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | MYC | 100 | (61) | (6) | (55) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | MYC | 100 | (70) | (10) | (60) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 3.200 | (1.148) | (564) | (584) | (0,11) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 200 | (72) | (41) | (31) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 800 | (287) | (168) | (119) | (0,03) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 600 | (215) | (79) | (136) | (0,02) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | € 100 | (27) | (8) | (19) | 0,00 |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 800 | (216) | (86) | (130) | (0,02) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 800 | (216) | (85) | (131) | (0,02) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 1.700 | (459) | (186) | (273) | (0,04) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 1.500 | (405) | (162) | (243) | (0,04) |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | $ 2.500 | (211) | (192) | (19) | (0,02) |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 1.200 | (29) | (32) | 3 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | BPS | 1.800 | (110) | (83) | (27) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | GST | 1.000 | (61) | (46) | (15) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | JPM | 5.000 | (307) | (240) | (67) | (0,03) |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 800 | (29) | (19) | (10) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 1.200 | (298) | (62) | (236) | (0,03) |
| PHH Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | BRC | 4.500 | 130 | 391 | (261) | 0,01 |
| PHH Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | CBK | 900 | 26 | 72 | (46) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 3.300 | (303) | (377) | 74 | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BRC | 2.300 | (181) | (214) | 33 | (0,02) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 1.100 | (101) | (123) | 22 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 1.900 | (162) | (206) | 44 | (0,02) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 1.700 | (156) | (119) | (37) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 3.900 | (333) | (428) | 95 | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 2.100 | (193) | (248) | 55 | (0,02) |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | BRC | € 2.000 | (56) | 1 | (57) | 0,00 |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | JPM | 800 | (22) | 2 | (24) | 0,00 |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | MYC | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.12.2019 | CBK | $ 2.000 | (296) | 101 | (397) | (0,03) |
| Teck Resources Ltd. | 5,000 % | 20.12.2020 | BPS | 200 | (73) | (39) | (34) | (0,01) |
| Teck Resources Ltd. | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 300 | (109) | (10) | (99) | (0,01) |
| Telefonica S.A. | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | € 2.000 | (33) | (114) | 81 | 0,00 |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | $ 3.700 | (257) | (233) | (24) | (0,02) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | CBK | 4.900 | (309) | (294) | (15) | (0,03) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | HUS | 4.800 | (303) | (292) | (11) | (0,03) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 1.500 | (113) | (96) | (17) | (0,01) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | BOA | 1.450 | (915) | (812) | (103) | (0,09) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | BOA | 900 | (570) | (610) | 40 | (0,05) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | BPS | 400 | (253) | (269) | 16 | (0,02) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | 500 | (316) | (334) | 18 | (0,03) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 600 | (380) | (398) | 18 | (0,04) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | HUS | 11.400 | (7.191) | (7.179) | (12) | (0,68) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | HUS | 400 | (253) | (269) | 16 | (0,02) |
| Venezuela Government International Bond | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 1.000 | (633) | (669) | 36 | (0,06) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | € 100 | (3) | (8) | 5 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 400 | (11) | (31) | 20 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 1.800 | (47) | (122) | 75 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 2.200 | (58) | (117) | 59 | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 800 | (21) | (89) | 68 | 0,00 |
| | | | | | $ (18.210) | $ (15.453) | $ (2.757) | (1,73) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 934 | $ | 679 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.590 | | 4.741 | NAB | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 33.759 | | 8.938 | DUB | 405 | 0 | 405 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 8.615 | BRL | 33.759 | DUB | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| 01/2016 | CHF | 3.534 | $ | 3.443 | CBK | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 155.533 | € | 141.548 | BOA | 0 | (1.769) | (1.769) | (0,17) |
| 01/2016 | | 162 | | 149 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 143.036 | $ | 152.503 | BOA | 0 | (2.877) | (2.877) | (0,27) |
| 01/2016 | $ | 5.148 | € | 4.753 | CBK | 18 | (3) | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 4.057 | $ | 4.315 | CBK | 0 | (92) | (92) | (0,01) |
| 01/2016 | | 1.136 | | 1.213 | GLM | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.733 | € | 4.359 | JPM | 32 | (30) | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 137 | | 125 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 4.044 | $ | 4.282 | UAG | 0 | (111) | (111) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 1.715 | € | 1.622 | UAG | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.858 | $ | 2.816 | BOA | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| 01/2016 | | 10 | | 15 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 57.549 | | 86.755 | DUB | 1.934 | 0 | 1.934 | 0,18 |
| 01/2016 | | 417 | | 632 | HUS | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.160 | | 1.744 | JPM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 90.973 | £ | 61.304 | JPM | 0 | (618) | (618) | (0,06) |
| 01/2016 | £ | 320 | $ | 480 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.088 | JPY | 990.200 | FBF | 144 | 0 | 144 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 3.705.609 | $ | 30.337 | GLM | 0 | (468) | (468) | (0,04) |
| 01/2016 | | 18.500 | | 151 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 24.736 | JPY | 2.993.009 | MSB | 144 | 0 | 144 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 259.100 | $ | 2.107 | UAG | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 5.469.336 | | 4.704 | FBF | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 20.171 | | 4.658 | BPS | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 33.759 | | 8.531 | DUB | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 141.548 | | 155.644 | BOA | 1.771 | 0 | 1.771 | 0,17 |
| 02/2016 | £ | 61.304 | | 90.976 | JPM | 614 | 0 | 614 | 0,06 |
| 02/2016 | $ | 189 | IDR | 2.659.805 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 70.656 | $ | 1.059 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 2.993.009 | | 24.750 | MSB | 0 | (146) | (146) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 6.532 | | 4.639 | SCX | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 166.629 | | 4.641 | BOA | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 151.472 | | 4.636 | GLM | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 79.355 | | 4.628 | GLM | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 204 | PLN | 810 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 9.180 | $ | 1.415 | JPM | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| 10/2016 | | 48.660 | | 7.521 | SCX | 328 | 0 | 328 | 0,03 |
| | | | | | | $ 5.934 | $ (6.426) | $ (492) | (0,05) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (18.678)** | **(1,77)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.048.131** | **99,20** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 327 | $ 481 | 0,05 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 17 | 17 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.779 | 15 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 478 | 478 | 0,05 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 18 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 152 | 10 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 149 | 149 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 0 | 1 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 707 | 46 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 144 | 144 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1.567 | 1.702 | 0,16 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 749 | 6 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 103 | 152 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Bank** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 3 | $ 3 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | **$ 3.218** | **0,30** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | **$ 5.196** | **0,50** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.056.545** | **100,00** |

ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 21.679 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

(e) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 19.390 und Barmittel in Höhe von USD 4.393 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.936 und Barmittel von USD 5.195 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 553 und Barmittel in Höhe von USD 717 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(h) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 52.200 | $ 1.018.604 | $ 490 | $ 1.071.294 |
| Finanzderivate[3] | 956 | (24.119) | 0 | (23.163) |
| **Summen** | **$ 53.156** | **$ 994.485** | **$ 490** | **$ 1.048.131** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 127.105 | $ 1.678.178 | $ 2.825 | $ 1.808.108 |
| Finanzderivate[3] | (55) | 5.373 | 0 | 5.318 |
| **Summen** | **$ 127.050** | **$ 1.683.551** | **$ 2.825** | **$ 1.813.426** |

(i) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 100.687 | $ 110.609 | BOA | $ 1.249 | $ (17) | $ 1.232 | 0,12 |
| 01/2016 | $ 113.172 | € 106.146 | BOA | 2.135 | 0 | 2.135 | 0,20 |
| 01/2016 | 13 | 12 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 295 | $ 324 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | 2.020 | 2.194 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 61 | € 57 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 10.079 | $ 10.973 | CBK | 64 | (40) | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 531 | € 496 | DUB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | 46.662 | 44.039 | GLM | 1.177 | 0 | 1.177 | 0,11 |
| 01/2016 | € 99.915 | $ 109.801 | HUS | 1.263 | 0 | 1.263 | 0,12 |
| 01/2016 | $ 114.014 | € 106.988 | HUS | 2.207 | 0 | 2.207 | 0,21 |
| 01/2016 | € 39.398 | $ 43.053 | JPM | 255 | 0 | 255 | 0,02 |
| 01/2016 | 27 | 29 | NAB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 332 | 362 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 129 | € 117 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 9 | 9 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 116.488 | $ 127.210 | UAG | 715 | (45) | 670 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 113.025 | € 106.355 | UAG | 2.508 | 0 | 2.508 | 0,24 |
| 02/2016 | 109.865 | 99.915 | BOA | 0 | (1.250) | (1.250) | (0,12) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € 1.589 | $ 1.746 | BOA | $ 19 | $ 0 | $ 19 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 109.879 | € 99.915 | HUS | 0 | (1.264) | (1.264) | (0,12) |
| 02/2016 | 43.083 | 39.398 | JPM | 0 | (254) | (254) | (0,02) |
| 02/2016 | € 9 | $ 9 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 110.517 | € 101.107 | UAG | 0 | (607) | (607) | (0,06) |
| | | | | $ 11.604 | $ (3.479) | $ 8.125 | 0,77 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 31.871 | £ 21.217 | AZD | $ 0 | $ (599) | $ (599) | (0,06) |
| 01/2016 | £ 850 | $ 1.285 | BOA | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.659 | £ 1.105 | BOA | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | 33.083 | 21.983 | BPS | 0 | (682) | (682) | (0,06) |
| 01/2016 | £ 202 | $ 304 | BPS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | 3.768 | 5.553 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 84.055 | 124.771 | CBK | 882 | 0 | 882 | 0,08 |
| 01/2016 | $ 118.603 | £ 78.503 | CBK | 0 | (2.897) | (2.897) | (0,27) |
| 01/2016 | 118.398 | 78.539 | DUB | 0 | (2.639) | (2.639) | (0,25) |
| 01/2016 | 60.217 | 39.993 | HUS | 0 | (1.271) | (1.271) | (0,12) |
| 01/2016 | £ 83.008 | $ 123.181 | JPM | 836 | 0 | 836 | 0,08 |
| 01/2016 | $ 128.175 | £ 84.056 | JPM | 0 | (4.285) | (4.285) | (0,41) |
| 01/2016 | 37 | 25 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 83.008 | $ 122.849 | SCX | 504 | 0 | 504 | 0,05 |
| 01/2016 | 73.671 | 109.005 | UAG | 421 | 0 | 421 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 29 | £ 19 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 122.568 | 82.588 | CBK | 0 | (832) | (832) | (0,08) |
| 02/2016 | 123.186 | 83.008 | JPM | 0 | (832) | (832) | (0,08) |
| 02/2016 | 122.859 | 83.008 | SCX | 0 | (504) | (504) | (0,05) |
| 02/2016 | £ 5 | $ 7 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 109.011 | £ 73.671 | UAG | 0 | (419) | (419) | (0,04) |
| | | | | $ 2.682 | $ (14.990) | $ (12.308) | (1,17) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 22 | $ 16 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 23 | 16 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 90 | 63 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 3 | 2 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 216 | SGD 306 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 419 | 591 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | 421 | 593 | SCX | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD 7 | $ 5 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |

**(j) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 47.465 | $ 51.801 | $ (198) | $ 0 | $ (198) | (0,02) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(k) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | (0,375 %) | 15.12.2015 | 15.12.2017 | $ 36 | $ (36) | 0,00 |
| MYI | (0,080 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | € 10.256 | (11.139) | (1,06) |
| MYI | (0,060 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 9.728 | (10.566) | (1,00) |
| | | | | | $ (21.741) | (2,06) |

**(l) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (599) | $ 421 | $ (178) |
| BOA | (2.557) | 2.873 | 316 |
| BPS | (957) | 645 | (312) |
| BRC | (1.325) | 1.207 | (118) |
| CBK | (5.185) | 4.550 | (635) |
| DUB | (289) | (359) | (648) |
| FBF | (92) | 265 | 173 |
| GLM | 592 | (3.070) | (2.478) |
| GST | (1.366) | 1.445 | 79 |
| HUS | (7.066) | 5.888 | (1.178) |
| JPM | (6.442) | 5.693 | (749) |
| MSB | (2) | 0 | (2) |
| MYC | (560) | 475 | (85) |
| NAB | (54) | 0 | (54) |
| SCX | 366 | (220) | 146 |
| UAG | 2.470 | (3.090) | (620) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(m) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 101,40 | 108,11 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,09 | 0,00 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,52) | (0,82) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (1,77) | 1,14 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Diversified Income Duration Hedged Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 56.600 | $ | 78.858 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,194 % fällig am 21.01.2016 | $ | 51.563 | | 51.549 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,219 % fällig am 07.01.2016 | | 46.151 | | 46.142 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,186 % fällig am 11.02.2016 | | 32.863 | | 32.834 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,020 % fällig am 09.04.2015 | | 28.269 | | 28.269 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 20.000 | | 22.985 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,007 % fällig am 17.09.2015 | | 20.600 | | 20.599 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 14.500 | | 16.472 |
| **Finmeccanica SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | | £8.000 | | 14.730 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,176 % fällig am 14.01.2016 | $ | 13.497 | | 13.496 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | | 11.600 | | 12.960 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 12.596 | | 12.633 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 10.900 | | 12.621 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 0,375 % fällig am 31.01.2016 | | 12.400 | | 12.411 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 11.000 | | 11.661 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 8.600 | | 11.473 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2015 | $ | 11.100 | | 11.100 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 10.000 | | 11.063 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 5.400 | | 11.041 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 8.900 | | 10.971 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 56.600 | $ | 77.373 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 7.544.061 | | 75.500 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 47.396 | | 53.778 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,039 % fällig am 02.04.2015 | | 40.369 | | 40.368 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,194 % fällig am 21.01.2016 | | 38.263 | | 38.253 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,186 % fällig am 11.02.2016 | | 32.863 | | 32.854 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 21.439 | | 24.554 |
| **H.J. Heinz Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.06.2020 | | 24.293 | | 24.293 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 21.11.2023 | | 22.649 | | 23.132 |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 20.400 | | 21.185 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,007 % fällig am 17.09.2015 | | 20.600 | | 20.600 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 17.100 | | 19.270 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | £ | 11.300 | | 18.232 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.09.2041 | € | 12.700 | | 17.901 |
| **Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.** | | | | |
| 5,298 % fällig am 27.12.2017 | $ | 19.600 | | 17.580 |
| **Finmeccanica SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 9.700 | | 17.394 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 12.600 | | 17.212 |
| **GTL Trade Finance, Inc.** | | | | |
| 5,893 % fällig am 29.04.2024 | $ | 16.530 | | 16.430 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 14.600 | | 16.403 |
| **Heta Asset Resolution AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 24.01.2017 | € | 20.600 | | 15.878 |

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO Dividend and Income Builder Fund

31. Dezember 2015

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Energy Future Intermediate Holding Co. LLC | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | $ | 207 | $ 207 | 0,19 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKING & FINANCE** | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 100 | 191 | 0,17 |
| Cantor Fitzgerald LP | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | $ | 90 | 99 | 0,09 |
| LBG Capital No.2 PLC | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 100 | 200 | 0,18 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 300 | 321 | 0,29 |
| Vnesheconombank Via VEB Finance PLC | | | | |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | $ | 200 | 203 | 0,19 |
| | | | 1.014 | 0,92 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Caesars Entertainment Operating Co., Inc. (a) | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2020 | | 56 | 43 | 0,04 |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 | | 49 | 37 | 0,04 |
| 11,250 % fällig am 01.06.2017 | | 28 | 21 | 0,02 |
| Corporation GEO SAB de C.V. | | | | |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 (a) | | 100 | 2 | 0,00 |
| Enterprise Inns PLC | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | £ | 50 | 79 | 0,07 |
| Hellenic Railways Organization S.A. | | | | |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 1.500 | 11 | 0,01 |
| iHeartCommunications, Inc. | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2019 | $ | 92 | 68 | 0,06 |
| Petroleos de Venezuela S.A. | | | | |
| 8,500 % fällig am 02.11.2017 | | 67 | 36 | 0,03 |
| Priory Group No.3 PLC | | | | |
| 8,875 % fällig am 15.02.2019 | £ | 100 | 153 | 0,14 |
| Spirit Issuer PLC | | | | |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | | 4 | 5 | 0,01 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 50 | 77 | 0,07 |
| | | | 532 | 0,49 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ | 43 | 43 | 0,04 |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 500 | 560 | 0,51 |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 2 | 1 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 12 | 8 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 17 | 13 | 0,01 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 110 | 82 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 27.01.2041 | | 4 | 3 | 0,00 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 10 | 6 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 65 | 58 | 0,05 |
| | | | 774 | 0,70 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 2.320 | 2,11 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Kanawha, West Virginia, Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2007 | | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | | 50 | 43 | 0,04 |
| Richmond, Virginia, Tobacco Settlement Finance Corporation Revenue Bonds, Series 2007 | | | | |
| 6,706 % fällig am 01.06.2046 | | 95 | 74 | 0,06 |
| | | | 117 | 0,10 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Alternative Loan Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 17 | 14 | 0,01 |
| Alternative Loan Trust Resecuritization | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 43 | 38 | 0,03 |
| American Home Mortgage Assets Trust | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 30 | 22 | 0,02 |
| Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates | | | | |
| 1,202 % fällig am 25.05.2034 | $ | 746 | $ 691 | 0,63 |
| Banc of America Alternative Loan Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 (a) | | 71 | 57 | 0,05 |
| Bear Stearns Alternative-A Trust (a) | | | | |
| 2,820 % fällig am 25.05.2036 | | 32 | 22 | 0,02 |
| 3,048 % fällig am 25.09.2035 | | 22 | 16 | 0,02 |
| Bear Stearns Mortgage Funding Trust | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.08.2036 | | 38 | 37 | 0,03 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | |
| 2,643 % fällig am 25.07.2046 (a) | | 21 | 18 | 0,02 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | |
| 0,982 % fällig am 25.04.2034 | | 11 | 10 | 0,01 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 15 | 13 | 0,01 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Certificates | | | | |
| 2,838 % fällig am 29.12.2037 | | 135 | 80 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 27.05.2037 | | 272 | 274 | 0,25 |
| Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust | | | | |
| 6,750 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 15 | 12 | 0,01 |
| Finance America Mortgage Loan Trust | | | | |
| 1,367 % fällig am 25.11.2034 | | 1.009 | 889 | 0,81 |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | |
| 4,007 % fällig am 19.06.2036 (a) | | 14 | 9 | 0,01 |
| HSI Asset Loan Obligation Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 10 | 9 | 0,01 |
| IndyMac INDX Mortgage Loan Trust | | | | |
| 2,389 % fällig am 25.06.2037 | | 33 | 19 | 0,02 |
| 2,652 % fällig am 25.08.2035 (a) | | 42 | 34 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 33 | 26 | 0,02 |
| JPMorgan Mortgage Trust | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 29 | 22 | 0,02 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | |
| 2,809 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 72 | 48 | 0,04 |
| RBSSP Resecuritization Trust | | | | |
| 9,391 % fällig am 26.06.2037 | | 61 | 36 | 0,03 |
| Residential Asset Mortgage Products Trust | | | | |
| 2,342 % fällig am 25.11.2034 | | 949 | 871 | 0,79 |
| Residential Funding Mortgage Securities I Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 17 | 16 | 0,02 |
| Wachovia Mortgage Loan Trust LLC Trust | | | | |
| 2,752 % fällig am 20.10.2035 (a) | | 711 | 647 | 0,59 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| 2,337 % fällig am 25.03.2036 | | 14 | 13 | 0,01 |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 440 | 380 | 0,35 |
| | | | 4.323 | 3,93 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B (b) | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2045 | BRL | 100 | 60 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 15.08.2050 | | 58 | 35 | 0,03 |
| Greece Government International Bond | | | | |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 6.000 | 48 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 2.100 | 17 | 0,02 |
| Venezuela Government International Bond | | | | |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 | $ | 100 | 40 | 0,04 |
| | | | 200 | 0,18 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Bridgestone Corp. | 44.225 | 1.516 | 1,38 |
| Comcast Corp. | 13.284 | 750 | 0,68 |
| G8 Education Ltd. | 673.692 | 1.739 | 1,58 |
| General Motors Co. | 72.557 | 2.468 | 2,24 |
| Kohl's Corp. | 26.855 | 1.279 | 1,16 |
| Macy's, Inc. | 35.864 | 1.254 | 1,14 |
| OPAP S.A. | 141.570 | 1.242 | 1,13 |
| SeaWorld Entertainment,Inc. | 50.773 | 1.000 | 0,91 |
| | | 11.248 | 10,22 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 51.312 | $ 1.480 | 1,35 |
| Coca-Cola Femsa SAB deC.V. | 70.900 | 506 | 0,46 |
| Ebro Foods S.A. | 86.358 | 1.698 | 1,54 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 19.194 | 1.014 | 0,92 |
| Magnit PJSC | 10.985 | 442 | 0,40 |
| | | 5.140 | 4,67 |
| **ENERGIE** | | | |
| Golar LNG Partners LP | 79.038 | 1.057 | 0,96 |
| Schlumberger Ltd. | 27.796 | 1.939 | 1,76 |
| | | 2.996 | 2,72 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aegon NV | 528.070 | 2.985 | 2,71 |
| HSBC Holdings PLC | 439.767 | 3.471 | 3,15 |
| ICAP PLC | 225.707 | 1.694 | 1,54 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 931.229 | 3.091 | 2,81 |
| Lloyds Banking Group PLC | 2.776.048 | 2.986 | 2,71 |
| Navient Corp. | 80.573 | 923 | 0,84 |
| NN Group NV | 42.957 | 1.515 | 1,38 |
| Outfront Media, Inc. | 67.905 | 1.482 | 1,35 |
| Prudential Financial, Inc. | 24.589 | 2.002 | 1,82 |
| | | 20.149 | 18,31 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AbbVie, Inc. | 52.083 | 3.085 | 2,80 |
| Merck & Co., Inc. | 40.240 | 2.125 | 1,93 |
| Pfizer, Inc. | 93.342 | 3.013 | 2,74 |
| Qualicorp S.A. | 129.482 | 461 | 0,42 |
| Roche Holding AG | 11.728 | 3.252 | 2,96 |
| Sonic Healthcare Ltd. | 117.569 | 1.520 | 1,38 |
| | | 13.456 | 12,23 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Arteris S.A. | 391.200 | 954 | 0,87 |
| RR Donnelley & Sons Co. | 136.870 | 2.015 | 1,83 |
| Societa Iniziative Autostradali e ServiziSpA | 107.326 | 1.140 | 1,03 |
| Spotless Group HoldingsLtd. | 2.530.415 | 1.979 | 1,80 |
| | | 6.088 | 5,53 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Cisco Systems, Inc. | 92.671 | 2.517 | 2,29 |
| QUALCOMM, Inc. | 81.932 | 4.095 | 3,72 |
| Symantec Corp. | 81.878 | 1.719 | 1,56 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 463.099 | 1.998 | 1,82 |
| Western Digital Corp. | 32.536 | 1.954 | 1,77 |
| | | 12.283 | 11,16 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Covestro AG | 30.809 | 1.126 | 1,02 |
| International Paper Co. | 65.870 | 2.483 | 2,26 |
| | | 3.609 | 3,28 |
| **TELECOMMUNICATION SERVICES** | | | |
| AT & T, Inc. | 119.933 | 4.127 | 3,75 |
| CenturyLink, Inc. | 74.517 | 1.875 | 1,70 |
| China Mobile Ltd. | 223.601 | 2.517 | 2,29 |
| PCCW Ltd. | 880.000 | 514 | 0,47 |
| Total Access CommunicationPCL | 472.383 | 395 | 0,36 |
| Vodafone Group PLC | 1.135.672 | 3.682 | 3,34 |
| | | 13.110 | 11,91 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Capital Power Corp. | 134.372 | 1.719 | 1,56 |
| Engie S.A. | 123.851 | 2.193 | 1,99 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Dividend and Income Builder Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Light S.A. | 155.619 | $ 389 | 0,35 |
| PG & E Corp. | 75.264 | 4.003 | 3,64 |
| | | 8.304 | 7,54 |
| Summe Stammaktien | | 96.383 | 87,57 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Colony Capital, Inc. | 174.990 | 3.409 | 3,10 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 276.189 | 2.762 | 2,51 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 109.721** | **99,69** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| British pound Currency March Futures | Short | 03/2016 | 8 | $ 13 | 0,01 |
| Euro Currency March Futures | Short | 03/2016 | 2 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 14 | 0,01 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 14** | **0,01** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CAD | 258 | $ | 186 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 6.306 | | 6.723 | BOA | 0 | (127) | (127) | (0,12) |
| 01/2016 | | 5 | | 5 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 51 | € | 47 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 32 | | 29 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.888 | | 6.306 | UAG | 0 | (38) | (38) | (0,03) |
| 01/2016 | | 8.474 | £ | 5.710 | CBK | 0 | (58) | (58) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 5.710 | $ | 8.609 | MSB | 193 | 0 | 193 | 0,18 |
| 02/2016 | € | 6.306 | | 6.893 | UAG | 38 | 0 | 38 | 0,03 |
| 02/2016 | £ | 5.710 | | 8.474 | CBK | 57 | 0 | 57 | 0,05 |
| | | | | | | $ 288 | $ (223) | $ 65 | 0,06 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 65** | **0,06** |
| **Summe Anlagen** | **$ 109.800** | **99,76** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5 | $ 8 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 15 | 15 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 569 | 5 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 414 | 414 | 0,38 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 6 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 5 | 0,01 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 2 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 129 | 129 | 0,12 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 3 | 3 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 13 | 9 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 124 | $ | 124 | 0,11 |
| **Nordea Bank AB** | | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 1 | | 0 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | | 4 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 240 | | 2 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | | 3 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **725** | **0,66** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **(463)** | **(0,42)** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **110.062** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Der PIMCO Dividend and Income Builder Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(d) Barmittel in Höhe von USD 52 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(e) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 57.641 | $ 52.080 | $ 0 | $ 109.721 |
| Finanzderivate[3] | 14 | 65 | 0 | 79 |
| **Summen** | **$57.655** | **$52.145** | **$0** | **$109.800** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 70.820 | $ 65.586 | $ 81 | $ 136.487 |
| Finanzderivate[3] | 44 | 215 | 0 | 259 |
| **Summen** | **$ 70.864** | **$65.801** | **$81** | **$136.746** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(f) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 18 | AUD | 24 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 135 | $ | 97 | NAB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 21 | BRL | 82 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 82 | $ | 22 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 82 | | 21 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 20 | BRL | 82 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 82 | $ | 20 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | CAD | 19 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 160 | $ | 120 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.292 | CHF | 1.326 | BOA | 33 | 0 | 33 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 25 | $ | 25 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.021 | CHF | 1.051 | BPS | 28 | 0 | 28 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 83 | $ | 83 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 30 | CHF | 30 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 105 | $ | 106 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.289 | CHF | 1.326 | FBF | 36 | 0 | 36 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 50 | $ | 50 | SOG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.306 | CHF | 1.326 | UAG | 19 | 0 | 19 | 0,02 |
| 01/2016 | DKK | 160 | $ | 23 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 384 | | 409 | BOA | 0 | (8) | (8) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Dividend and Income Builder Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 17 | € | 16 | BPS | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 26 | | 24 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11 | £ | 7 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 174 | $ | 262 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 01/2016 | INR | 204 | | 3 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 38.004 | | 310 | BOA | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | KRW | 80.152 | | 69 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 72 | | 16 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 76 | | 9 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 13 | RUB | 929 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 929 | $ | 14 | SOG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 395 | | 46 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 28 | HKD | 217 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 1.138 | $ | 147 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 155.675 | | 11 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 2.077 | | 31 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 22 | | 16 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 1.736 | | 53 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 368 | | 21 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 929 | | 13 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 05/2016 | PLN | 33 | | 8 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 465 | | 32 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 134 | $ (17) | $ 117 | 0,11 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 7 | $ | 5 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | AUD | 20 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.524 | | 2.092 | CBK | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 20 | $ | 14 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | AUD | 3 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.100 | $ | 1.511 | NAB | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 10 | AUD | 14 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 3 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 9 | | 13 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 4 | $ | 3 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 334 | BRL | 1.310 | DUB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.310 | $ | 347 | DUB | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 7 | CAD | 10 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 10 | $ | 7 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.862 | CAD | 2.566 | BOA | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| 01/2016 | | 10 | | 14 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 9 | $ | 7 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4 | CAD | 5 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 2.555 | $ | 1.919 | MSB | 80 | 0 | 80 | 0,07 |
| 01/2016 | | 21 | | 15 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | CAD | 19 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 1.962 | $ | 1.911 | BOA | 0 | (49) | (49) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 12 | CHF | 12 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10 | | 10 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 7 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 3 | $ | 3 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | CHF | 2 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 22 | $ | 22 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.981 | CHF | 1.962 | MSB | 0 | (20) | (20) | (0,02) |
| 01/2016 | | 15 | | 15 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 7 | $ | 7 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 2.605 | | 372 | SCX | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 17.022 | | 18.699 | BOA | 211 | (3) | 208 | 0,19 |
| 01/2016 | $ | 18.831 | € | 17.662 | BOA | 355 | 0 | 355 | 0,32 |
| 01/2016 | € | 1.123 | $ | 1.228 | BPS | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 01/2016 | | 749 | | 814 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.404 | | 20.102 | CBK | 121 | (13) | 108 | 0,10 |
| 01/2016 | $ | 19.853 | € | 18.705 | CBK | 469 | (4) | 465 | 0,43 |
| 01/2016 | € | 71 | $ | 75 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 605 | | 643 | NAB | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| 01/2016 | | 506 | | 552 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 146 | | 160 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | € | 0 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.245 | | 7.786 | SOG | 213 | 0 | 213 | 0,19 |
| 01/2016 | € | 7.903 | $ | 8.631 | SOG | 46 | 0 | 46 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 18.996 | € | 17.873 | UAG | 421 | 0 | 421 | 0,38 |
| 01/2016 | € | 16.719 | $ | 18.262 | UAG | 100 | (1) | 99 | 0,09 |
| 01/2016 | £ | 3 | | 5 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8 | £ | 5 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 48 | | 32 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 37 | $ | 56 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12 | £ | 8 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 9 | £ | 6 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 4 | $ | 6 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.712 | £ | 2.508 | MSB | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 2.522 | $ | 3.802 | MSB | 85 | 0 | 85 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 30 | £ | 20 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11 | | 7 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | HKD | 1 | $ | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | HKD | 111 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 512.306 | $ | 4.175 | BOA | 0 | (83) | (83) | (0,08) |
| 01/2016 | $ | 38 | JPY | 4.615 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6 | | 714 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13 | | 1.554 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 1.120 | $ | 9 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | JPY | 134 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.197 | | 507.866 | MSB | 25 | 0 | 25 | 0,02 |
| 01/2016 | | 29 | | 3.529 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 24 | | 2.886 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 4.374 | $ | 36 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 818.753 | | 700 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 1.140 | | 260 | SCX | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 1.250 | | 144 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 179 | RUB | 12.638 | MSB | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 12.638 | $ | 192 | SOG | 20 | 0 | 20 | 0,02 |
| 01/2016 | SEK | 4.508 | | 520 | CBK | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| 01/2016 | TRY | 480 | | 163 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3 | AUD | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.627 | $ | 1.181 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 1.310 | | 331 | DUB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4 | CAD | 5 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 2.032 | $ | 1.463 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4 | CHF | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 1.949 | $ | 1.970 | MSB | 20 | 0 | 20 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 18.587 | € | 16.904 | BOA | 0 | (211) | (211) | (0,19) |
| 02/2016 | € | 131 | $ | 143 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 18.590 | € | 16.995 | CBK | 0 | (116) | (116) | (0,11) |
| 02/2016 | € | 0 | $ | 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.637 | € | 7.903 | SOG | 0 | (46) | (46) | (0,04) |
| 02/2016 | | 18.095 | | 16.554 | UAG | 0 | (99) | (99) | (0,09) |
| 02/2016 | £ | 2.508 | $ | 3.713 | MSB | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 9 | £ | 6 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 191 | $ | 25 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 22 | HKD | 169 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 13 | $ | 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 12 | HKD | 96 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 35 | $ | 5 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 14.236 | | 1.837 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 1.941.847 | | 139 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 1.049 | | 271 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 24.615 | | 369 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8 | JPY | 915 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2 | | 294 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 507.866 | $ | 4.200 | MSB | 0 | (25) | (25) | (0,02) |
| 02/2016 | SGD | 351 | | 249 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 22.634 | | 696 | UAG | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| 03/2016 | MXN | 3.780 | | 217 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 12.638 | | 174 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 05/2016 | PLN | 556 | | 138 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 5.023 | | 340 | BOA | 23 | 0 | 23 | 0,02 |
| | | | | | | $ 2.264 | $ (777) | $ 1.487 | 1,35 |

**(g) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Markt-wert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 2.706 | $ 2.953 | $ (11) | $ 0 | $ (11) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(h) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 119 | $ (280) | $ (161) |
| BPS | 37 | 0 | 37 |
| CBK | 441 | (420) | 21 |
| DUB | 19 | 0 | 19 |
| FBF | 36 | 0 | 36 |
| GLM | (11) | 0 | (11) |
| MSB | 372 | (260) | 112 |
| NAB | (32) | 0 | (32) |
| RBC | 2 | 0 | 2 |
| SCX | (10) | 0 | (10) |
| SOG | 235 | (310) | (75) |
| UAG | 450 | (420) | 30 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(i) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,69 | 97,72 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,01 | 0,03 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,06 | 0,16 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO Dividend and Income Builder Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 14.662.232 | $ 146.714 |
| HSBC Holdings PLC | 648.450 | 5.865 |
| Carrefour S.A. | 138.072 | 4.404 |
| AT & T, Inc. | 119.933 | 4.169 |
| AbbVie, Inc. | 66.816 | 4.061 |
| Spotless Group Holdings Ltd. | 2.774.078 | 3.937 |
| E.ON SE | 228.506 | 3.501 |
| QUALCOMM, Inc. | 58.560 | 3.316 |
| Colony Capital, Inc. | 133.553 | 3.290 |
| Li & Fung Ltd. | 3.398.000 | 3.124 |
| Capital Power Corp. | 148.974 | 2.929 |
| G8 Education Ltd. | 1.044.882 | 2.901 |
| RR Donnelley & Sons Co. | 166.340 | 2.893 |
| | **PARI (000S)** | |
| Slovenia Government International Bond 5,850 % fällig am 10.05.2023 | $ 2.500 | 2.866 |
| | **AKTIEN** | |
| Navient Corp. | 178.489 | 2.848 |
| Ameren Corp. | 74.846 | 2.838 |
| Golar LNG Partners LP | 112.863 | 2.819 |
| Targa Resources Corp. | 33.490 | 2.816 |
| Aegon NV | 385.530 | 2.708 |
| NN Group NV | 93.046 | 2.654 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 14.390.029 | $ 143.990 |
| Target Corp. | 53.582 | 4.283 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 74.282 | 3.752 |
| JPMorgan Chase & Co. | 56.172 | 3.733 |
| Bridgestone Corp. | 85.100 | 3.340 |
| Suez Environnement Co. | 176.270 | 3.293 |
| Kohl's Corp. | 55.872 | 3.191 |
| Solar Capital Ltd. | 171.873 | 3.178 |
| Navient Corp. | 214.041 | 3.128 |
| E.ON SE | 228.506 | 3.127 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 47.500 | 3.114 |
| Ameren Corp. | 74.846 | 3.113 |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd. | 50.754 | 2.984 |
| Carrefour S.A. | 86.760 | 2.976 |
| ONE Gas, Inc. | 67.490 | 2.919 |
| | **PARI (000S)** | |
| Slovenia Government International Bond 5,850 % fällig am 10.05.2023 | $ 2.500 | 2.869 |
| | **AKTIEN** | |
| Electricite de France S.A. | 132.829 | 2.761 |
| Lloyds Banking Group PLC | 2.330.567 | 2.685 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 31.787 | 2.559 |
| Li & Fung Ltd. | 3.398.000 | 2.541 |

(a) Der PIMCO Dividend and Income Builder Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Asia Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BERMUDA** | | | | |
| **Beijing Enterprises Water Capital Management Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 06.05.2018 | $ | 300 | $ 308 | 0,56 |
| **China Oil & Gas Group Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 07.05.2020 | | 200 | 180 | 0,33 |
| **Li & Fung Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.11.2049 | | 200 | 208 | 0,38 |
| | | | 696 | 1,27 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 300 | 293 | 0,54 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.04.2049 | | 200 | 203 | 0,37 |
| **CLP Power HK Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.05.2049 | | 200 | 202 | 0,37 |
| **FPT Finance Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 28.09.2020 | | 400 | 438 | 0,80 |
| **Haitong International Finance 2014 Ltd.** | | | | |
| 3,990 % fällig am 11.09.2019 | | 200 | 200 | 0,37 |
| **HKT Capital No.2 Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 02.04.2025 | | 200 | 196 | 0,36 |
| **HLP Finance Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.04.2021 | | 250 | 256 | 0,47 |
| **King Power Capital Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 03.11.2019 | | 200 | 203 | 0,37 |
| **Oceanwide Holdings International 2015 Co. Ltd.** | | | | |
| 9,625 % fällig am 11.08.2020 | | 250 | 256 | 0,47 |
| **Rosy Unicorn Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 09.02.2017 | | 200 | 208 | 0,38 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 27.03.2020 | | 200 | 190 | 0,35 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | | 600 | 582 | 1,07 |
| **Towngas Finance Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.01.2049 | | 200 | 207 | 0,38 |
| **Wiseyear Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2021 | | 300 | 328 | 0,60 |
| **Yuexiu REIT MTN Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 14.05.2018 | | 200 | 199 | 0,36 |
| | | | 3.668 | 6,72 |
| **KANADA** | | | | |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | | 600 | 465 | 0,85 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Agile Property Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,875 % fällig am 20.03.2017 | | 200 | 210 | 0,39 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.11.2021 | | 800 | 777 | 1,42 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2020 | | 500 | 495 | 0,91 |
| **BCP Singapore VI Cayman Financing Co. Ltd.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.04.2021 | | 100 | 80 | 0,15 |
| **CAR, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 11.02.2021 | | 200 | 201 | 0,37 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 23.01.2021 | | 400 | 392 | 0,72 |
| **China Resources Land Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.02.2024 | | 200 | 223 | 0,41 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 04.04.2021 | | 200 | 209 | 0,38 |
| **Formosa Group Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 22.04.2025 | | 400 | 384 | 0,70 |
| **Future Land Development Holdings Ltd.** | | | | |
| 10,250 % fällig am 21.07.2019 | | 200 | 217 | 0,40 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 06.10.2019 | $ | 200 | $ 207 | 0,38 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 300 | 305 | 0,56 |
| **Greentown China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 04.02.2018 | | 221 | 231 | 0,42 |
| **Hutchison Whampoa International 14 Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 31.10.2024 | | 900 | 895 | 1,64 |
| **Hutchison Whampoa International Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 11.09.2019 | | 200 | 222 | 0,41 |
| **KWG Property Holding Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 05.08.2019 | | 300 | 312 | 0,57 |
| **Longfor Properties Co. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 18.10.2019 | | 300 | 318 | 0,58 |
| **New World China Land Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 06.11.2019 | | 200 | 208 | 0,38 |
| **PHBS Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 29.09.2049 | | 200 | 201 | 0,37 |
| **Semiconductor Manufacturing International Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.10.2019 | | 200 | 201 | 0,37 |
| **Shimao Property Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 22.01.2021 | | 500 | 539 | 0,99 |
| **Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 14.02.2022 | | 300 | 320 | 0,59 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 16.10.2017 | | 400 | 427 | 0,78 |
| **Swire Pacific MTN Financing Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 28.02.2022 | | 200 | 215 | 0,39 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 11.02.2025 | | 200 | 196 | 0,36 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 200 | 177 | 0,32 |
| | | | 8.162 | 14,96 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **UOB Cayman I Ltd.** | | | | |
| 5,796 % fällig am 29.12.2049 | | 450.000 | 454 | 0,83 |
| Summe Cayman Inseln | | | 8.616 | 15,79 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 13.11.2024 | $ | 200 | 207 | 0,38 |
| **CCCI Treasure Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2049 | | 400 | 394 | 0,72 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 | | 800 | 791 | 1,45 |
| **China Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.07.2075 | | 200 | 196 | 0,36 |
| **China Uranium Development Co. Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 08.10.2018 | | 200 | 204 | 0,37 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2019 | | 800 | 799 | 1,46 |
| **CRCC Yupeng Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 28.02.2049 | | 400 | 406 | 0,75 |
| **Dianjian Haixing Ltd.** | | | | |
| 4,050 % fällig am 29.10.2049 | | 500 | 507 | 0,93 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.09.2025 | | 600 | 609 | 1,12 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.07.2025 | | 200 | 199 | 0,37 |
| **Proven Honour Capital Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 19.05.2025 | | 400 | 395 | 0,72 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | | 1.000 | 1.020 | 1,87 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 28.04.2020 | | 400 | 394 | 0,72 |
| | | | 6.121 | 11,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of China** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.05.2016 | CNH | 4.000 | $ 606 | 1,11 |
| Summe China | | | 6.727 | 12,33 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 13.03.2023 | $ | 300 | 292 | 0,54 |
| **Bank of China Hong Kong Ltd.** | | | | |
| 5,550 % fällig am 11.02.2020 | | 400 | 436 | 0,80 |
| **Bao-trans Enterprises Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.12.2018 | | 200 | 202 | 0,37 |
| **Charming Light Investments Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.09.2019 | | 200 | 202 | 0,37 |
| **China Cinda Finance 2015 I Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 23.04.2020 | | 500 | 489 | 0,89 |
| **China Clean Energy Development Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 05.11.2025 | | 200 | 197 | 0,36 |
| **China Overseas Finance Cayman III Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 29.10.2018 | | 300 | 303 | 0,56 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 400 | 399 | 0,73 |
| **CITIC Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.01.2018 | | 800 | 865 | 1,58 |
| **CNOOC Finance 2011 Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | | 1.800 | 1.876 | 3,44 |
| **Huaneng Hong Kong Capital Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 11.06.2018 | | 200 | 200 | 0,37 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.10.2023 | | 200 | 203 | 0,37 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 25.04.2019 | | 400 | 421 | 0,77 |
| **Talent Yield Investments Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.04.2022 | | 600 | 623 | 1,14 |
| **Wharf Finance Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 08.02.2017 | | 250 | 257 | 0,47 |
| **Wheelock Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.03.2018 | | 200 | 201 | 0,37 |
| | | | 7.166 | 13,13 |
| Summe Hongkong | | | 7.166 | 13,13 |
| **INDIEN** | | | | |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 12.08.2021 | | 200 | 204 | 0,37 |
| **Bharti Airtel International Netherlands BV** | | | | |
| 5,350 % fällig am 20.05.2024 | | 200 | 211 | 0,39 |
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | | 200 | 196 | 0,36 |
| **Delhi International Airport Pvt Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 03.02.2022 | | 200 | 197 | 0,36 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 12.08.2020 | | 300 | 298 | 0,55 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.11.2019 | | 200 | 152 | 0,28 |
| **Oil India Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 17.04.2024 | | 300 | 321 | 0,59 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 | | 200 | 204 | 0,37 |
| **Reliance Holding USA, Inc.** | | | | |
| 5,400 % fällig am 14.02.2022 | | 850 | 921 | 1,69 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.04.2024 | | 500 | 536 | 0,98 |
| **Tata Motors Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.04.2020 | | 200 | 203 | 0,37 |
| | | | 3.443 | 6,31 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | € | 500 | 514 | 0,94 |
| 4,750 % fällig am 08.01.2026 | $ | 600 | 594 | 1,09 |
| 5,950 % fällig am 08.01.2046 | | 200 | 198 | 0,36 |
| **Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.04.2017 | | 300 | 303 | 0,56 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Listrindo Capital BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 21.02.2019 | $ | 200 | $ 206 | 0,38 |
| **Majapahit Holding BV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | | 805 | 904 | 1,65 |
| **Pelabuhan Indonesia II PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 200 | 178 | 0,33 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 4,300 % fällig am 20.05.2023 | | 300 | 273 | 0,50 |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | | 400 | 349 | 0,64 |
| **Perusahaan Gas Negara Persero Tbk PT** | | | | |
| 5,125 % fällig am 16.05.2024 | | 300 | 288 | 0,53 |
| | | | 3.807 | 6,98 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **IRLAND** | | | | |
| **PIMCO China Bond Fund (a)** | | 157.155 | 1.741 | 3,19 |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 3.370 | 339 | 0,62 |
| **PIMCO US Short-Term Fund (a)** | | 111.995 | 1.120 | 2,05 |
| | | | 3.200 | 5,86 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **West China Cement Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 11.09.2019 | $ | 400 | 422 | 0,77 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **Axiata SPV1 Labuan Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 28.04.2020 | | 200 | 218 | 0,40 |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 22.05.2022 | | 400 | 500 | 0,92 |
| | | | 718 | 1,32 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Indo Energy Finance II BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.01.2023 | | 200 | 83 | 0,15 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.04.2024 | | 200 | 207 | 0,38 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **Energy Development Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.01.2021 | | 200 | 220 | 0,40 |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 3,950 % fällig am 20.01.2040 | | 400 | 406 | 0,74 |
| 4,200 % fällig am 21.01.2024 | | 200 | 217 | 0,40 |
| 6,375 % fällig am 15.01.2032 | | 900 | 1.152 | 2,11 |
| **Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.** | | | | |
| 7,390 % fällig am 02.12.2024 | $ | 250 | $ 323 | 0,59 |
| **Royal Capital B.V.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.05.2049 | | 200 | 201 | 0,37 |
| **San Miguel Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 26.04.2023 | | 300 | 281 | 0,52 |
| **Security Bank Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 03.02.2020 | | 200 | 205 | 0,38 |
| **SM Investments Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.06.2024 | | 200 | 202 | 0,37 |
| | | | 3.207 | 5,88 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **Alam Synergy Pte Ltd.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 27.03.2020 | | 250 | 211 | 0,39 |
| **BOC Aviation Pte Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | | 200 | 197 | 0,36 |
| **Global Logistic Properties Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | | 500 | 490 | 0,90 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2024 | | 500 | 510 | 0,94 |
| **Pratama Agung Pte Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 24.02.2020 | | 300 | 292 | 0,53 |
| **STATS ChipPAC Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 24.11.2020 | | 200 | 192 | 0,35 |
| **Temasek Financial I Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.07.2042 | | 300 | 273 | 0,50 |
| **Theta Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 14.11.2020 | | 400 | 375 | 0,69 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.09.2024 | | 200 | 203 | 0,37 |
| | | | 2.743 | 5,03 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.04.2022 | | 600 | 673 | 1,23 |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2024 | | 400 | 407 | 0,75 |
| 4,375 % fällig am 30.09.2024 | | 300 | 309 | 0,57 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.09.2022 | | 200 | 202 | 0,37 |
| 3,750 % fällig am 22.01.2024 | | 400 | 418 | 0,77 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.09.2022 | | 700 | 698 | 1,28 |
| **Korea Resources Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.04.2020 | | 300 | 295 | 0,54 |
| **Korean Reinsurance Co.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.10.2044 | | 200 | 204 | 0,37 |
| **Shinhan Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.04.2020 | $ | 200 | $ 197 | 0,36 |
| **Shinsegae Co. Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2045 | | 600 | 589 | 1,08 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2024 | | 700 | 718 | 1,31 |
| | | | 4.710 | 8,63 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 14.01.2019 | | 200 | 197 | 0,36 |
| 6,250 % fällig am 04.10.2020 | | 200 | 194 | 0,36 |
| | | | 391 | 0,72 |
| **THAILAND** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 4,800 % fällig am 18.10.2020 | | 300 | 323 | 0,59 |
| **PTT Exploration & Production PCL** | | | | |
| 4,875 % fällig am 29.12.2049 | | 700 | 684 | 1,26 |
| **RH International Singapore Corporation Pte Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.05.2019 | | 300 | 306 | 0,56 |
| | | | 1.313 | 2,41 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 291 | 0,53 |
| **Vedanta Resources PLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 07.06.2021 | | 400 | 235 | 0,43 |
| | | | 526 | 0,96 |
| **VIETNAM** | | | | |
| **Vingroup JSC** | | | | |
| 11,625 % fällig am 07.05.2018 | | 250 | 269 | 0,49 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 96.594 | 966 | 1,77 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente - Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 53.636** | **98,29** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | $ 1.900 | $ (24) | (0,05) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (24)** | **(0,05)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,038 | 04.02.2016 | € 500 | $ 6 | $ 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 300 | 14 | 16 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,000 | 28.03.2016 | 200 | 9 | 10 | 0,02 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Asia Bond Fund (Forts.)

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNY 7,350 | 19.02.2016 | $ 4.500 | $ 2 | $ 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,550 | 19.09.2016 | 400 | 10 | 16 | 0,03 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BPS | JPY 119,000 | 13.01.2016 | 2.400 | 13 | 5 | 0,01 |
| Put - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 2,810 | 02.02.2016 | 300 | 4 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 58 | $ 49 | 0,09 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,143 | 04.02.2016 | € 500 | $ (6) | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 300 | (6) | (8) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,300 | 28.03.2016 | 200 | (4) | (5) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 7,000 | 19.09.2016 | 790 | (11) | (11) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | NGF | 7,000 | 31.10.2016 | 400 | (5) | (7) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 400 | (10) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | RUB 70,000 | 19.01.2016 | 200 | (3) | (9) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 74,000 | 09.03.2016 | 200 | (4) | (7) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus South African rand | DUB | ZAR 15,000 | 19.02.2016 | 100 | (2) | (5) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.210,000 | 15.02.2016 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | UAG | 1.210,000 | 16.02.2016 | 200 | (2) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 3,070 | 02.02.2016 | 300 | (3) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,800 | 28.03.2016 | 300 | (6) | (5) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,800 | 28.03.2016 | 200 | (4) | (3) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,370 | 19.09.2016 | 400 | (3) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 400 | (9) | (12) | (0,02) |
| | | | | | $ (80) | $ (78) | (0,14) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | $ 1.200 | $ 0 | $ (2) | $ 2 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | JPM | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 1.000 | 1 | 7 | (6) | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 100 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 100 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ (1) | $ 1 | $ (2) | 0,00 |

[1] Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 10,910 % | 02.01.2017 | BPS | BRL 1.500 | $ 18 | $ 1 | $ 17 | 0,04 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | BPS | 1.500 | (9) | 1 | (10) | (0,02) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | BPS | 4.500 | 18 | 2 | 16 | 0,03 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | DUB | 1.900 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | HUS | 3.000 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | CBK | 1.100 | (19) | (4) | (15) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | UAG | 4.650 | (75) | (13) | (62) | (0,14) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | BPS | 1.600 | 26 | 10 | 16 | 0,05 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | HUS | 3.500 | 57 | 46 | 11 | 0,10 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,375 % | 02.01.2018 | HUS | 10.100 | (115) | 0 | (115) | (0,21) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | GLM | 2.100 | (21) | (1) | (20) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | HUS | 3.000 | (8) | 0 | (8) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 800 | (22) | (1) | (21) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BPS | 2.600 | (73) | (2) | (71) | (0,13) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 600 | (17) | (1) | (16) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | HUS | 3.420 | (72) | 18 | (90) | (0,13) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,315 % | 04.01.2021 | HUS | 6.300 | 128 | 0 | 128 | 0,24 |
| | | | | | | $ (187) | $ 56 | $ (243) | (0,34) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 2.254 | $ | 572 | BOA | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 577 | BRL | 2.254 | BOA | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 2.931 | $ | 751 | BPS | 10 | 0 | 10 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 750 | BRL | 2.931 | BPS | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| 01/2016 | | 4.095 | | 15.492 | DUB | 0 | (179) | (179) | (0,33) |
| 01/2016 | BRL | 15.492 | $ | 3.955 | DUB | 39 | 0 | 39 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 225 | BRL | 874 | FBF | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 874 | $ | 224 | FBF | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | | 291 | | 74 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 75 | BRL | 291 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.053 | $ | 267 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 270 | BRL | 1.053 | JPM | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 42 | $ | 11 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11 | BRL | 42 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 44 | CNH | 282 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.388 | CNY | 34.649 | BOA | 0 | (95) | (95) | (0,17) |
| 01/2016 | CNY | 2.243 | $ | 347 | BPS | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | | 322 | | 50 | BRC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 864 | | 132 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.369 | | 823 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 131 | | 20 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 145 | | 155 | BPS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 468 | | 509 | CBK | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 670 | € | 613 | UAG | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | | 13 | HKD | 102 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 45 | | 347 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.455 | INR | 428.692 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| 01/2016 | INR | 23.670 | $ | 356 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 43.773 | | 658 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 28.295 | | 24 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 169.344 | | 144 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 20.642 | | 18 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 68.910 | | 60 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 301.112 | | 258 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.192 | KRW | 7.282.904 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 207.990 | $ | 179 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 81.409 | | 71 | RYL | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 42 | | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 139 | MYR | 599 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 84 | $ | 19 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.064 | MYR | 9.064 | SCX | 37 | 0 | 37 | 0,07 |
| 01/2016 | PEN | 2.119 | $ | 646 | BOA | 25 | 0 | 25 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 626 | PEN | 2.119 | FBF | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 01/2016 | PHP | 3.717 | $ | 79 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.386 | | 177 | BRC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 965 | PHP | 45.447 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 3.822 | $ | 57 | BOA | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 5.001 | RUB | 337.674 | BRC | 0 | (399) | (399) | (0,73) |
| 01/2016 | | 85 | | 5.601 | DUB | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| 01/2016 | | 62 | | 4.073 | FBF | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 01/2016 | | 71 | | 4.685 | GLM | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 3.261 | $ | 49 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | | 1.602 | | 24 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 196 | RUB | 12.862 | SOG | 0 | (21) | (21) | (0,04) |
| 01/2016 | TRY | 66 | $ | 23 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 15 | | 5 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 949 | TRY | 2.801 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 02/2016 | BRL | 2.931 | $ | 743 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 256 | BRL | 1.029 | BRC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 710 | $ | 176 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.715 | BRL | 14.701 | DUB | 0 | (37) | (37) | (0,07) |
| 02/2016 | | 176 | | 710 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 77 | COP | 246.785 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 9.699 | $ | 3 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 706 | COP | 2.072.121 | HUS | 0 | (56) | (56) | (0,10) |
| 02/2016 | COP | 253.530 | $ | 80 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 2.258 | | 91 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.624 | CZK | 40.810 | CBK | 18 | 0 | 18 | 0,03 |
| 02/2016 | CZK | 7.955 | $ | 314 | JPM | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | | 178 | | 7 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 380 | | 15 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 613 | | 670 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | HKD | 579 | | 75 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 75 | HKD | 581 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 3.846.960 | $ | 274 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 167.652 | | 12 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.781.898 | | 269 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.538 | IDR | 35.616.027 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 51 | | 719.913 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 425 | ILS | 1.647 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 573 | $ | 147 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 525 | INR | 35.512 | BRC | 7 | 0 | 7 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Asia Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | SGD | 26 | $ | 18 | BPS | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 201 | | 142 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.449 | SGD | 6.276 | HUS | 0 | (33) | (33) | (0,06) |
| 02/2016 | SGD | 265 | $ | 187 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.775 | THB | 63.738 | BOA | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 02/2016 | THB | 286 | $ | 8 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.977 | | 220 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 1.854 | | 56 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.911 | | 58 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.367 | TWD | 77.161 | JPM | 0 | (28) | (28) | (0,05) |
| 02/2016 | TWD | 5.079 | $ | 155 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.138 | | 125 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | HUF | 20.075 | | 69 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 436 | | 25 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 5.989 | MXN | 102.693 | GLM | 0 | (73) | (73) | (0,13) |
| 03/2016 | MXN | 618 | $ | 36 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 1.073 | PEN | 3.599 | BRC | 0 | (29) | (29) | (0,05) |
| 03/2016 | PEN | 122 | $ | 36 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 2.119 | | 619 | FBF | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 13 | PEN | 45 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 34 | | 117 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 62 | $ | 16 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 236 | RUB | 17.594 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 325 | | 24.284 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 6.653 | $ | 424 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 86 | ZAR | 1.360 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 3.266 | $ | 202 | GLM | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 597 | ZAR | 9.126 | JPM | 0 | (16) | (16) | (0,03) |
| 04/2016 | | 894 | CLP | 636.230 | BPS | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 05/2016 | HUF | 56.097 | $ | 191 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 05/2016 | $ | 3.701 | PLN | 14.694 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| 05/2016 | | 2.010 | ZAR | 30.173 | BOA | 0 | (110) | (110) | (0,20) |
| 07/2016 | BRL | 5.413 | $ | 1.370 | BPS | 82 | 0 | 82 | 0,15 |
| 07/2016 | CNH | 3.688 | | 550 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 07/2016 | $ | 550 | CNY | 3.691 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 282 | $ | 43 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 09/2016 | | 2.042 | | 310 | BRC | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| 09/2016 | | 1.252 | | 190 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 09/2016 | | 1.058 | | 160 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 09/2016 | | 3.173 | | 480 | JPM | 10 | 0 | 10 | 0,02 |
| 10/2016 | $ | 91 | ARS | 1.620 | FBF | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 10/2016 | | 245 | BRL | 1.066 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 1.064 | $ | 245 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 4.300 | | 665 | SCX | 29 | 0 | 29 | 0,05 |
| 11/2016 | $ | 80 | ARS | 1.440 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2017 | CNH | 3.730 | $ | 550 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2017 | $ | 550 | CNY | 3.738 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 373 | $ (1.173) | $ (800) | (1,47) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (1.017)** | **(1,86)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 52.595** | **96,38** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | $ 12 | 0,02 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2.142 | 18 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 325 | 325 | 0,60 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 21 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 101 | 101 | 0,19 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 98 | 98 | 0,18 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 20 | 14 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 902 | 8 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ 2 | $ 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | **$ 585** | **1,07** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | **$ 1.388** | **2,55** |
| **Nettovermögen** | | **$ 54.568** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der Emerging Asia Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 570 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(c) Barmittel in Höhe von USD 78 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(d) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.166 | $ 49.470 | $ 0 | $ 53.636 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (1.041) | 0 | (1.041) |
| **Summen** | **$ 4.166** | **$ 48.429** | **$ 0** | **$ 52.595** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.808 | $ 81.743 | $ 0 | $ 86.551 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (3.285) | 0 | (3.285) |
| **Summen** | **$ 4.808** | **$ 78.458** | **$ 0** | **$ 83.266** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(e) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (222) | $ 0 | $ (222) |
| BPS | 75 | 0 | 75 |
| BRC | (413) | 290 | (123) |
| CBK | 10 | 0 | 10 |
| DUB | (180) | (220) | (400) |
| FBF | (2) | 0 | (2) |
| GLM | (103) | 0 | (103) |
| HUS | (102) | 0 | (102) |
| JPM | (30) | 0 | (30) |
| MSB | 7 | 0 | 7 |
| MYC | (17) | 0 | (17) |
| NGF | (7) | 0 | (7) |
| RYL | 2 | 0 | 2 |
| SCX | 72 | 0 | 72 |
| SOG | (28) | 0 | (28) |
| UAG | (79) | 280 | (201) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(f) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,29 | 94,18 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,05) | 0,06 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (1,86) | (3,63) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Asia Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 4.877.547 | $ 48.807 |
| | **PARI (000S)** | |
| **CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.** | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | $ 2.700 | 2.643 |
| **CNOOC Finance 2011 Ltd.** | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | 2.000 | 2.091 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | 2.100 | 2.001 |
| **Indonesia Government International Bond** | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | 1.500 | 1.483 |
| **Philippines Government International Bond** | | |
| 4,200 % fällig am 21.01.2024 | 1.100 | 1.217 |
| **Reliance Holding USA, Inc.** | | |
| 5,400 % fällig am 14.02.2022 | 1.100 | 1.200 |
| **China Construction Bank Corp.** | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 | 1.200 | 1.193 |
| **Philippines Government International Bond** | | |
| 6,375 % fällig am 15.01.2032 | 900 | 1.191 |
| **Global Logistic Properties Ltd.** | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | 1.100 | 1.091 |
| **King Power Capital Ltd.** | | |
| 3,875 % fällig am 03.11.2019 | 1.000 | 1.024 |
| **US Treasury Notes** | | |
| 1,250 % fällig am 31.10.2019 | 1.000 | 1.005 |
| **Security Bank Corp.** | | |
| 3,950 % fällig am 03.02.2020 | 1.000 | 1.000 |
| **China Cinda Finance 2015 I Ltd.** | | |
| 3,125 % fällig am 23.04.2020 | 1.000 | 997 |
| **Woori Bank** | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2024 | 900 | 953 |
| **Hutchison Whampoa International 14 Ltd.** | | |
| 3,625 % fällig am 31.10.2024 | 900 | 898 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | |
| 3,800 % fällig am 11.02.2025 | 900 | 896 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | |
| 4,125 % fällig am 28.01.2025 | 900 | 891 |
| **China Shanshui Cement Group Ltd.** | | |
| 7,500 % fällig am 10.03.2020 | 900 | 891 |
| **CITIC Ltd.** | | |
| 6,875 % fällig am 21.01.2018 | 800 | 886 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAVFund (a) | 5.116.591 | $ 51.200 |
| | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | |
| 1,250 % fällig am 31.10.2019 | $ 3.100 | 3.116 |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | 3.000 | 3.091 |
| **CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.** | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | 2.700 | 2.651 |
| **Hutchison Whampoa International Ltd.** | | |
| 5,750 % fällig am 11.09.2019 | 2.300 | 2.601 |
| **Majapahit Holding BV** | | |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | 2.000 | 2.320 |
| **SM Investments Corp.** | | |
| 4,875 % fällig am 10.06.2024 | 2.300 | 2.283 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | |
| 7,000 % fällig am 31.01.2016 | RUB 142.000 | 2.209 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd.** | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2020 | $ 2.000 | 2.155 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.** | | |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | 2.000 | 2.070 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | 2.000 | 1.968 |
| **Yuexiu REIT MTN Co.** | | |
| 3,100 % fällig am 14.05.2018 | 1.800 | 1.785 |
| **Swire Pacific MTN Financing Ltd.** | | |
| 4,500 % fällig am 28.02.2022 | 1.500 | 1.636 |
| **Franshion Brilliant Ltd.** | | |
| 5,750 % fällig am 19.03.2019 | 1.500 | 1.603 |
| **Indonesia Government International Bond** | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | 1.500 | 1.562 |
| **FPT Finance Ltd.** | | |
| 6,375 % fällig am 28.09.2020 | 1.400 | 1.531 |
| **Berau Coal Energy Tbk PT** | | |
| 7,250 % fällig am 13.03.2017 | 3.000 | 1.527 |
| **Energy Development Corp.** | | |
| 6,500 % fällig am 20.01.2021 | 1.385 | 1.509 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | 1.400 | 1.426 |
| **Shinhan Bank** | | |
| 5,663 % fällig am 02.03.2035 | 1.400 | 1.404 |

(a) Der Emerging Asia Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund

31. Dezember 2015

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BERMUDA** | | | | |
| Ooredoo International Finance Ltd. | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.10.2016 | $ | 500 | $ 506 | 0,02 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Banco do Brasil S.A. | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.01.2016 | € | 4.500 | 4.891 | 0,19 |
| Banco Santander Brasil S.A. | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | $ | 4.000 | 3.995 | 0,16 |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | | 10.400 | 10.540 | 0,41 |
| Banco Votorantim S.A. | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2016 | | 1.775 | 1.776 | 0,07 |
| Caixa Economica Federal | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.11.2017 | | 8.650 | 7.980 | 0,31 |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | | 1.600 | 1.478 | 0,06 |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 18.240 | 17.830 | 0,70 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 16.900 | 16.689 | 0,65 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 6.700 | 5.109 | 0,20 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 12.100 | 11.117 | 0,43 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | | 21.700 | 21.640 | 0,84 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 3.000 | 2.362 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 06.10.2016 | | 1.100 | 1.092 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 4.700 | 4.171 | 0,16 |
| | | | 110.670 | 4,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | | 3.200 | 3.176 | 0,12 |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 10.200 | 10.072 | 0,39 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | BRL | 318.300 | 77.802 | 3,03 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | | 14.800 | 3.490 | 0,14 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 84.400 | 19.134 | 0,75 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 157.670 | 34.435 | 1,34 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2017 | | 58.300 | 11.772 | 0,46 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2018 | | 220.235 | 38.021 | 1,48 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2019 | | 16.400 | 2.430 | 0,09 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 380.979 | 76.896 | 2,99 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 305.880 | 55.317 | 2,15 |
| | | | 332.545 | 12,94 |
| Summe Brasilien | | | 443.215 | 17,25 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd. | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | $ | 24.000 | 23.894 | 0,93 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| Alibaba Group Holding Ltd. | | | | |
| 0,932 % fällig am 28.11.2017 | | 1.700 | 1.689 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 28.11.2017 | | 9.900 | 9.785 | 0,38 |
| Anstock II Ltd. | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.07.2017 | | 23.400 | 23.118 | 0,90 |
| Dryden XVI-Leveraged Loan CDO | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.10.2020 | | 1.081 | 1.077 | 0,04 |
| Interoceanica IV Finance Ltd. | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2018 | | 1.224 | 1.150 | 0,04 |
| Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd. | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 785 | 290 | 0,01 |
| Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 1.746 | 402 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 536 | 128 | 0,01 |
| QNB Finance Ltd. | | | | |
| 1,572 % fällig am 31.10.2016 | | 12.900 | 12.935 | 0,50 |
| | | | 50.574 | 1,97 |
| **CHILE** | | | | |
| Banco Santander Chile | | | | |
| 1,221 % fällig am 11.04.2017 | | 4.800 | 4.746 | 0,18 |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 2.600 | 2.599 | 0,10 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2023 (a) | CLP | 128.145 | $ 222 | 0,01 |
| Bonos del Banco Central de Chile en UF (a) | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.05.2017 | | 102.516 | 149 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2018 | | 102.516 | 153 | 0,01 |
| | | | 7.869 | 0,31 |
| **CHINA** | | | | |
| China Government International Bond | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2022 | CNH | 500 | 74 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | | | | |
| 3,350 % fällig am 18.06.2017 | | 57.000 | 8.601 | 0,33 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd. | | 74.800 | 235 | 0,01 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd. | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | $ | 48.000 | 47.941 | 1,87 |
| | | | 56.851 | 2,21 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| Colombia Government International Bond | | | | |
| 7,750 % fällig am 14.04.2021 | COP | 1.080.000 | 349 | 0,01 |
| 9,850 % fällig am 28.06.2027 | | 5.045.000 | 1.822 | 0,07 |
| Colombian TES | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.11.2018 | | 231.123.000 | 69.111 | 2,69 |
| 6,000 % fällig am 28.04.2028 | | 5.000 | 1 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 04.05.2022 | | 151.505.500 | 45.322 | 1,76 |
| 7,250 % fällig am 15.06.2016 | | 10.887.000 | 3.454 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 26.08.2026 | | 90.061.000 | 26.261 | 1,02 |
| 10,000 % fällig am 24.07.2024 | | 84.630.000 | 29.469 | 1,15 |
| Ecopetrol S.A. | | | | |
| 7,625 % fällig am 23.07.2019 | $ | 1.500 | 1.631 | 0,06 |
| Empresas Publicas de Medellin ESP | | | | |
| 7,625 % fällig am 10.09.2024 | COP | 17.497.000 | 4.770 | 0,19 |
| 8,375 % fällig am 01.02.2021 | | 26.732.000 | 8.103 | 0,32 |
| Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter | | | | |
| 7,875 % fällig am 12.08.2024 | | 20.812.000 | 5.786 | 0,23 |
| | | | 196.079 | 7,63 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| Czech Republic Government Bond | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 105.400 | 4.277 | 0,17 |
| Czech Republic Ministry of Finance Bill | | | | |
| (0,260 %) fällig am 11.03.2016 | | 12.000 | 483 | 0,02 |
| (0,260 %) fällig am 15.04.2016 | | 40.000 | 1.608 | 0,06 |
| (0,250 %) fällig am 02.09.2016 | | 13.000 | 523 | 0,02 |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | | 145.000 | 5.836 | 0,23 |
| | | | 12.727 | 0,50 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| Deutsche Bank AG | | | | |
| 0,882 % fällig am 30.05.2017 | $ | 900 | 895 | 0,03 |
| **HONGKONG** | | | | |
| CNOOC Finance 2013 Ltd. | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.05.2016 | | 2.800 | 2.796 | 0,11 |
| CNOOC Nexen Finance 2014 ULC | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 3.800 | 3.780 | 0,15 |
| CNPC General Capital Ltd. | | | | |
| 1,450 % fällig am 16.04.2016 | | 5.000 | 5.000 | 0,19 |
| | | | 11.576 | 0,45 |
| **UNGARN** | | | | |
| Hungary Government Bond | | | | |
| 5,500 % fällig am 12.02.2016 | HUF | 149.800 | $ 517 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 24.11.2023 | | 2.000.000 | 8.144 | 0,32 |
| 6,500 % fällig am 24.06.2019 | | 307.200 | 1.198 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 12.11.2020 | | 658.500 | 2.755 | 0,11 |
| | | | 12.614 | 0,49 |
| **INDIEN** | | | | |
| Indian Railway Finance Corp. Ltd. | | | | |
| 4,406 % fällig am 30.03.2016 | $ | 300 | 302 | 0,01 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| Indonesia Government International Bond | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2028 | IDR | 352.425.000 | 20.145 | 0,78 |
| 6,375 % fällig am 15.04.2042 | | 143.808.000 | 7.521 | 0,29 |
| 6,625 % fällig am 15.05.2033 | | 151.402.000 | 8.669 | 0,34 |
| 6,875 % fällig am 09.03.2017 | $ | 5.800 | 6.147 | 0,24 |
| 6,875 % fällig am 17.01.2018 | | 1.900 | 2.065 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2022 | IDR | 11.500.000 | 757 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2027 | | 72.723.000 | 4.557 | 0,18 |
| 8,250 % fällig am 15.07.2021 | | 133.927.000 | 9.503 | 0,37 |
| 8,250 % fällig am 15.06.2032 | | 74.607.000 | 4.998 | 0,20 |
| 8,750 % fällig am 15.02.2044 | | 59.202.000 | 4.084 | 0,16 |
| 10,000 % fällig am 15.09.2024 | | 84.000.000 | 6.472 | 0,25 |
| 10,000 % fällig am 15.02.2028 | | 338.674.000 | 26.270 | 1,02 |
| 10,250 % fällig am 15.07.2022 | | 37.629.000 | 2.904 | 0,11 |
| 10,500 % fällig am 15.08.2030 | | 309.458.000 | 25.139 | 0,98 |
| 10,500 % fällig am 15.07.2038 | | 133.080.000 | 10.823 | 0,42 |
| 11,000 % fällig am 15.09.2025 | | 85.453.000 | 7.009 | 0,27 |
| 11,750 % fällig am 15.08.2023 | | 2.200.000 | 184 | 0,01 |
| 12,800 % fällig am 15.06.2021 | | 61.560.000 | 5.201 | 0,20 |
| 12,900 % fällig am 15.06.2022 | | 127.081.000 | 11.006 | 0,43 |
| Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.04.2017 | $ | 2.300 | 2.326 | 0,09 |
| Majapahit Holding BV | | | | |
| 7,750 % fällig am 17.10.2016 | | 200 | 209 | 0,01 |
| | | | 165.989 | 6,46 |
| **IRLAND** | | | | |
| Novatek OAO via Novatek Finance Ltd. | | | | |
| 5,326 % fällig am 03.02.2016 | | 300 | 301 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 21.02.2017 | RUB | 775.100 | 10.157 | 0,40 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO China Bond Fund (b) | | 820.410 | 9.090 | 0,36 |
| PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (b) | | 717.930 | 72.224 | 2,81 |
| PIMCO US Short-Term Fund (b) | | 5.533.276 | 55.333 | 2,15 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Russian Railways via RZD Capital PLC | | | | |
| 8,300 % fällig am 02.04.2019 | RUB | 1.593.800 | 20.272 | 0,79 |
| | | | 167.377 | 6,52 |
| **ISRAEL** | | | | |
| Delek & Avner Tamar Bond Ltd. | | | | |
| 2,803 % fällig am 30.12.2016 | $ | 6.000 | 5.998 | 0,23 |
| Israel Electric Corp. Ltd. | | | | |
| 5,625 % fällig am 21.06.2018 | | 1.800 | 1.905 | 0,08 |
| | | | 7.903 | 0,31 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JAPAN** | | | | |
| Japan Treasury Bills | | | | |
| (0,016 %) fällig am 22.02.2016 | JPY | 9.210.000 | $ 76.564 | 2,98 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| Intergas Finance BV | | | | |
| 6,375 % fällig am 14.05.2017 | $ | 291 | 298 | 0,01 |
| KazMunayGas National Co. JSC | | | | |
| 9,125 % fällig am 02.07.2018 | | 6.400 | 7.062 | 0,28 |
| Samruk-Energy JSC | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 9.300 | 9.114 | 0,35 |
| | | | 16.474 | 0,64 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 4,950 % fällig am 23.05.2016 | | 6.900 | 6.960 | 0,27 |
| 6,212 % fällig am 22.11.2016 | | 9.700 | 9.975 | 0,39 |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 11.400 | 12.312 | 0,48 |
| Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A. | | | | |
| 8,625 % fällig am 17.02.2017 | RUB | 242.900 | 3.239 | 0,13 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | $ | 5.700 | 5.806 | 0,22 |
| | | | 38.292 | 1,49 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| Export-Import Bank of Malaysia Bhd. | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.12.2017 | | 400 | 405 | 0,02 |
| Malaysia Government International Bond | | | | |
| 3,260 % fällig am 01.03.2018 | MYR | 56.700 | 13.237 | 0,52 |
| 3,314 % fällig am 31.10.2017 | | 47.368 | 11.156 | 0,43 |
| 3,480 % fällig am 15.03.2023 | | 20.384 | 4.549 | 0,18 |
| 3,492 % fällig am 31.03.2020 | | 9.247 | 2.144 | 0,08 |
| 3,502 % fällig am 31.05.2027 | | 10.500 | 2.225 | 0,09 |
| 3,580 % fällig am 28.09.2018 | | 314.425 | 74.075 | 2,88 |
| 3,795 % fällig am 30.09.2022 | | 68.760 | 15.775 | 0,61 |
| 3,814 % fällig am 15.02.2017 | | 32.000 | 7.535 | 0,29 |
| 3,844 % fällig am 15.04.2033 | | 16.000 | 3.364 | 0,13 |
| 3,892 % fällig am 15.03.2027 | | 6.300 | 1.397 | 0,06 |
| 4,012 % fällig am 15.09.2017 | | 37.575 | 8.947 | 0,35 |
| 4,127 % fällig am 15.04.2032 | | 700 | 153 | 0,01 |
| 4,160 % fällig am 15.07.2021 | | 4.073 | 963 | 0,04 |
| 4,181 % fällig am 15.07.2024 | | 39.100 | 9.080 | 0,35 |
| 4,378 % fällig am 29.11.2019 | | 51.257 | 12.347 | 0,48 |
| 4,392 % fällig am 15.04.2026 | | 2.800 | 656 | 0,03 |
| 4,444 % fällig am 22.05.2024 | | 14.720 | 3.397 | 0,13 |
| 4,498 % fällig am 15.04.2030 | | 6.800 | 1.569 | 0,06 |
| 4,709 % fällig am 15.09.2026 | | 12.650 | 3.010 | 0,12 |
| 4,837 % fällig am 15.07.2025 (f) | | 400 | 97 | 0,00 |
| 4,935 % fällig am 30.09.2043 | | 13.400 | 3.183 | 0,12 |
| | | | 179.264 | 6,98 |
| **MARSHALLINSELN** | | | | |
| Nakilat, Inc. | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 175 | 193 | 0,01 |
| **MEXIKO** | | | | |
| America Movil SAB de C.V. | | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 238.500 | 13.160 | 0,51 |
| 8,460 % fällig am 18.12.2036 | | 76.800 | 4.258 | 0,17 |
| 9,000 % fällig am 15.01.2016 | | 43.500 | 2.523 | 0,10 |
| Corporation GEO SAB de C.V. (c) | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 | $ | 250 | 5 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 | | 700 | 15 | 0,00 |
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. | | | | |
| | | **AKTIEN** | | |
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. | | 212.074 | 0 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| 6,030 % fällig am 28.06.2018 (c) | MXN | 22.130 | 109 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (a) | | 133.475 | 8.513 | 0,33 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | | 765.150 | 44.569 | 1,73 |
| 7,750 % fällig am 23.11.2034 | | 116.190 | 7.372 | 0,29 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | MXN | 311.000 | $ 19.821 | 0,77 |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029 | | 593.460 | 40.261 | 1,57 |
| 10,000 % fällig am 20.11.2036 | | 36.510 | 2.833 | 0,11 |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 4,875 % fällig am 24.01.2022 | $ | 2.000 | 1.930 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2018 | | 2.000 | 2.087 | 0,08 |
| 7,190 % fällig am 12.09.2024 | MXN | 494.600 | 26.583 | 1,03 |
| 9,150 % fällig am 28.03.2016 | | 185.500 | 11.139 | 0,43 |
| Telefonos de Mexico SAB de C.V. | | | | |
| 8,750 % fällig am 31.01.2016 | | 26.300 | 1.529 | 0,06 |
| Urbi Desarrollos Urbanos SAB de C.V. | | | | |
| 8,330 % fällig am 09.12.2014 (c) | | 29.700 | 138 | 0,01 |
| | | | 186.845 | 7,27 |
| **PERU** | | | | |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | PEN | 29.700 | 7.917 | 0,31 |
| 6,850 % fällig am 12.02.2042 | | 10.560 | 2.775 | 0,11 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037 | | 32.020 | 8.515 | 0,33 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 53.250 | 14.567 | 0,57 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 29.590 | 9.170 | 0,35 |
| | | | 42.944 | 1,67 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| Philippines Government International Bond | | | | |
| 3,900 % fällig am 26.11.2022 | PHP | 370.000 | 7.581 | 0,29 |
| 4,950 % fällig am 15.01.2021 | | 241.000 | 5.216 | 0,20 |
| Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. | | | | |
| 6,875 % fällig am 02.11.2016 | $ | 400 | 417 | 0,02 |
| | | | 13.214 | 0,51 |
| **POLEN** | | | | |
| Poland Government International Bond | | | | |
| 1,500 % fällig am 25.04.2020 | PLN | 102.900 | 25.281 | 0,98 |
| 2,000 % fällig am 25.04.2021 | | 11.100 | 2.749 | 0,11 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2018 | | 7.300 | 1.884 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2026 | | 11.100 | 2.651 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2019 | | 36.800 | 9.712 | 0,38 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | | 137.100 | 35.734 | 1,39 |
| 3,750 % fällig am 25.04.2018 | | 16.200 | 4.294 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | | 104.900 | 28.813 | 1,12 |
| 5,750 % fällig am 25.10.2021 | | 106.260 | 31.730 | 1,24 |
| 5,750 % fällig am 23.09.2022 | | 152.680 | 45.982 | 1,79 |
| | | | 188.830 | 7,35 |
| **KATAR** | | | | |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | $ | 736 | 753 | 0,03 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| Romania Government International Bond | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.06.2019 | RON | 15.900 | 4.189 | 0,16 |
| 4,750 % fällig am 24.02.2025 | | 45.050 | 11.702 | 0,46 |
| 5,750 % fällig am 27.01.2016 | | 36.200 | 8.745 | 0,34 |
| 5,750 % fällig am 29.04.2020 | | 70.900 | 19.416 | 0,76 |
| 5,800 % fällig am 26.07.2027 | | 4.200 | 1.161 | 0,04 |
| 5,850 % fällig am 26.04.2023 | | 15.600 | 4.340 | 0,17 |
| 5,950 % fällig am 11.06.2021 | | 36.000 | 10.039 | 0,39 |
| | | | 59.592 | 2,32 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| Russia Government International Bond | | | | |
| 6,400 % fällig am 27.05.2020 | RUB | 371.000 | 4.518 | 0,18 |
| 6,700 % fällig am 15.05.2019 | | 816.100 | 10.310 | 0,40 |
| 6,800 % fällig am 11.12.2019 | | 187.500 | 2.337 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2023 | | 433.000 | 5.191 | 0,20 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2023 | | 146.400 | 1.742 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 27.02.2019 | | 1.036.600 | 13.359 | 0,52 |
| 7,600 % fällig am 14.04.2021 | | 942.800 | 11.834 | 0,46 |
| 7,600 % fällig am 20.07.2022 | | 509.500 | 6.338 | 0,25 |
| SCF Capital Ltd. | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.10.2017 | $ | 200 | 199 | 0,01 |
| VimpelCom Holdings BV | | | | |
| 9,000 % fällig am 13.02.2018 | RUB | 642.000 | 8.354 | 0,32 |
| | | | 64.182 | 2,50 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.08.2027 | ZAR | 97.400 | $ 1.283 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 31.12.2032 | | 247.600 | 1.983 | 0,08 |
| South Africa Government International Bond | | | | |
| 6,250 % fällig am 31.03.2036 | | 132.500 | 5.727 | 0,22 |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031 | | 486.546 | 23.990 | 0,93 |
| 7,250 % fällig am 15.01.2020 | | 3.700 | 224 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 28.02.2023 | | 29.800 | 1.749 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | | 172.500 | 9.452 | 0,37 |
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | | 565.000 | 31.112 | 1,21 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037 | | 79.600 | 4.371 | 0,17 |
| 8,750 % fällig am 31.01.2044 | | 4.000 | 221 | 0,01 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 28.200 | 1.620 | 0,06 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 286.300 | 19.552 | 0,76 |
| Transnet SOC Ltd. | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.02.2016 | $ | 1.000 | 1.002 | 0,04 |
| | | | 102.286 | 3,98 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| Korea Development Bank | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.05.2017 | | 400 | 411 | 0,02 |
| Korea Land & Housing Corp. | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.08.2017 | | 800 | 799 | 0,03 |
| Korea Western Power Co. Ltd. | | | | |
| 3,125 % fällig am 10.05.2017 | | 400 | 406 | 0,01 |
| | | | 1.616 | 0,06 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| Sri Lanka Government International Bond | | | | |
| 5,125 % fällig am 11.04.2019 | | 3.400 | 3.246 | 0,13 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung | | | | |
| 9,250 % fällig am 02.12.2020 | IDR | 73.080.000 | 5.366 | 0,21 |
| Europäische Investitionsbank | | | | |
| 6,950 % fällig am 06.02.2020 | | 58.660.000 | 3.976 | 0,16 |
| 7,200 % fällig am 09.07.2019 | | 28.180.000 | 1.897 | 0,07 |
| | | | 11.239 | 0,44 |
| **THAILAND** | | | | |
| Thailand Government Bond | | | | |
| 1,250 % fällig am 12.03.2028 (a) | THB | 1.171.355 | 28.741 | 1,12 |
| 3,450 % fällig am 08.03.2019 | | 132.000 | 3.864 | 0,15 |
| 3,625 % fällig am 16.06.2023 | | 47.310 | 1.424 | 0,05 |
| 3,650 % fällig am 17.12.2021 | | 91.650 | 2.746 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 22.06.2029 | | 36.000 | 1.239 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 12.01.2019 | | 17.800 | 551 | 0,02 |
| | | | 38.565 | 1,50 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| Export Credit Bank of Turkey | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2019 | $ | 4.000 | 4.138 | 0,16 |
| Turkey Government International Bond | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2020 (a) | TRY | 30.814 | 11.153 | 0,43 |
| 7,100 % fällig am 08.03.2023 | | 110.700 | 31.431 | 1,22 |
| 7,400 % fällig am 05.02.2020 | | 70.500 | 21.672 | 0,84 |
| 8,000 % fällig am 12.03.2025 | | 46.189 | 13.601 | 0,53 |
| 8,800 % fällig am 14.11.2018 | | 83.400 | 27.359 | 1,07 |
| 8,800 % fällig am 27.09.2023 | | 49.000 | 15.268 | 0,59 |
| 9,000 % fällig am 08.03.2017 | | 2.870 | 968 | 0,04 |
| 9,000 % fällig am 24.07.2024 | | 19.200 | 6.048 | 0,24 |
| 9,500 % fällig am 12.01.2022 | | 2.310 | 755 | 0,03 |
| 10,400 % fällig am 20.03.2024 | | 12.800 | 4.326 | 0,17 |
| Turkiye Garanti Bankasi | | | | |
| 2,817 % fällig am 20.04.2016 | $ | 2.500 | 2.502 | 0,10 |
| | | | 139.221 | 5,42 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| Barclays PLC | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 8.700 | 12.848 | 0,50 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Bluestone Securities PLC** | | | | |
| 0,778 % fällig am 09.06.2044 | £ | 1.428 | $ 1.990 | 0,08 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 9,875 % fällig am 16.12.2021 | $ | 945 | 1.012 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 700 | 731 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 318 | 0,01 |
| | | | 16.899 | 0,66 |
| **USA** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,995 % fällig am 18.07.2016 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,154 % fällig am 25.09.2045 | | 19 | 18 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | | 1.600 | 1.505 | 0,06 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,635 % fällig am 25.02.2036 (c) | | 4 | 3 | 0,00 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 32.000 | 1.987 | 0,08 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,735 % fällig am 25.01.2035 | $ | 5 | 4 | 0,00 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (c) | | 67 | 60 | 0,00 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | | 3.900 | 3.947 | 0,15 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.400 | 1.397 | 0,06 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 300 | 300 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,623 % fällig am 25.03.2034 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 2,905 % fällig am 25.09.2037 (c) | | 133 | 121 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,222 % fällig am 25.03.2035 | | 166 | 152 | 0,01 |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 2,254 % fällig am 01.07.2035 | $ | 63 | $ 65 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 2.100 | 2.106 | 0,08 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (c) | | 25 | 23 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 0,832 % fällig am 13.06.2016 | | 800 | 799 | 0,03 |
| 0,836 % fällig am 02.06.2017 | | 5.400 | 5.383 | 0,21 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,225 % fällig am 25.06.2036 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 0,972 % fällig am 03.03.2017 | | 1.900 | 1.896 | 0,07 |
| **PepsiCo, Inc.** | | | | |
| 0,617 % fällig am 26.02.2016 | | 1.100 | 1.100 | 0,04 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,422 % fällig am 15.12.2033 | € | 706 | 662 | 0,03 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,200 % fällig am 14.01.2016 (d) | $ | 2.023 | 2.023 | 0,08 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 45.700 | 45.571 | 1,77 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 0,428 % fällig am 31.10.2017 (e) | | 892 | 891 | 0,04 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,402 % fällig am 25.02.2037 (c) | | 83 | 73 | 0,00 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 0,716 % fällig am 02.06.2017 | | 2.900 | 2.889 | 0,11 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,738 % fällig am 25.07.2036 (c) | | 26 | 26 | 0,00 |
| | | | 73.213 | 2,85 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | |
| **Citigroup Global Markets, Inc.** | | | |
| 0,580 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022 bewertet mit $50.364. Die Rückkauferlöse betragen $49.303.) | $ 49.300 | $ 49.300 | 1,92 |
| **HSBC Bank PLC** | | | |
| 0,430 % fällig am 06.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert von Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2019 bewertet mit $14.691. Die Rückkauferlöse betragen $14.201.) | 14.200 | 14.200 | 0,55 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (b)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 5.061.594 | 50.626 | 1,97 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 2.525.929** | **98,32** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | $ 18.000 | $ 60 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 56.500 | (939) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 8,000 % | 16.03.2021 | ZAR 119.000 | (329) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 8,500 % | 16.03.2026 | 584.900 | (2.683) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 9,995 % | 16.03.2026 | 292.100 | (500) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 1,750 % | 16.09.2020 | PLN 5.300 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,000 % | 10.10.2019 | MXN 388.500 | 152 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,405 % | 19.11.2020 | 298.500 | (67) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,650 % | 02.06.2021 | 57.750 | (162) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 7,500 % | 02.06.2021 | 133.700 | (348) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,750 % | 31.08.2021 | 143.400 | (292) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,840 % | 14.09.2021 | 128.000 | 106 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,580 % | 10.11.2021 | 44.800 | (23) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,000 % | 22.02.2023 | 335.120 | (611) | (0,02) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,500 % | 22.02.2023 | 240.700 | (297) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 22.02.2023 | 170.000 | (532) | (0,02) |
| Erhalt | IBMEXID | 6,325 % | 04.12.2025 | 121.500 | 25 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 7,380 % | 09.02.2029 | 87.600 | (164) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,600 % | 28.06.2029 | 150.000 | (901) | (0,04) |
| Zahlung | IBMEXID | 8,760 % | 03.09.2029 | 4.000 | (26) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,710 % | 20.09.2029 | 36.000 | (5) | 0,00 |
| | | | | | $ (7.540) | (0,30) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (7.540)** | **(0,30)** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,038 | 04.02.2016 | € 21.200 | $ 271 | $ 27 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,200 | 25.02.2016 | $ 28.800 | 459 | 612 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 8.200 | 368 | 436 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,000 | 28.03.2016 | 7.400 | 325 | 393 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,550 | 19.09.2016 | 17.010 | 446 | 665 | 0,03 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BPS | JPY 119,000 | 13.01.2016 | 117.600 | 650 | 232 | 0,01 |
| Put - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 2,810 | 02.02.2016 | 14.100 | 172 | 19 | 0,00 |
| | | | | | $ 2.691 | $ 2.384 | 0,09 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,143 | 04.02.2016 | € 21.200 | $ (260) | $ (16) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,130 | 09.02.2016 | 25.700 | (175) | (51) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,000 | 10.03.2016 | $ 7.600 | (238) | (349) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,300 | 28.03.2016 | 8.200 | (175) | (212) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,300 | 28.03.2016 | 7.400 | (153) | (191) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 7,000 | 19.09.2016 | 34.030 | (458) | (475) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | NGF | 7,000 | 31.10.2016 | 19.700 | (241) | (324) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,050 | 08.12.2016 | 40.000 | (551) | (681) | (0,03) |
| Call - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 17.180 | (430) | (80) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | RUB 70,000 | 19.01.2016 | 7.300 | (108) | (345) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 74,000 | 09.03.2016 | 7.500 | (137) | (264) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus South African rand | DUB | ZAR 15,000 | 19.02.2016 | 7.100 | (102) | (360) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.210,000 | 15.02.2016 | 9.800 | (109) | (52) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | UAG | 1.210,000 | 16.02.2016 | 9.100 | (102) | (50) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 3,070 | 02.02.2016 | 14.100 | (158) | (57) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,697 | 25.02.2016 | 28.800 | (459) | (184) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 8.200 | (168) | (126) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,800 | 28.03.2016 | 7.400 | (159) | (114) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,370 | 19.09.2016 | 17.010 | (112) | (64) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 17.180 | (405) | (505) | (0,02) |
| | | | | | $ (4.700) | $ (4.500) | (0,18) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month PLN-WIBOR | Zahlung | 3,000 % | 10.02.2016 | PLN 5.000 | $ (5) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-MonthZAR-SAJIBOR | Zahlung | 9,000 % | 10.02.2016 | ZAR 25.000 | (15) | (60) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (20) | $ (60) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | $ 1.000 | $ (11) | $ (13) | $ 2 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 8.700 | (94) | (143) | 49 | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 3.700 | 0 | (11) | 11 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 1.000 | (11) | (13) | 2 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 14.100 | 1 | (8) | 9 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 3.600 | (39) | (47) | 8 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 1.600 | (8) | 1 | (9) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | JPM | 1.400 | (7) | 1 | (8) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | JPM | 800 | (9) | (9) | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 5.400 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 4.000 | (38) | 10 | (48) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 700 | 0 | 3 | (3) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 4.500 | (148) | (9) | (139) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 2.600 | (85) | (5) | (80) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 4.100 | (135) | 18 | (153) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | FBF | 300 | 0 | 1 | (1) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 700 | 1 | 5 | (4) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 10.000 | 1 | 3 | (2) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 8.300 | (273) | 4 | (277) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 8.600 | 6 | 57 | (51) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | HUS | 4.100 | (6) | (3) | (3) | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 300 | 1 | (9) | 10 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 200 | 1 | (5) | 6 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 1.900 | (5) | (14) | 9 | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | $ 2.000 | $ (5) | $ (20) | $ 15 | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 1.000 | (5) | (8) | 3 | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 1.900 | (10) | (16) | 6 | 0,00 |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 200 | (7) | (8) | 1 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | HUS | 500 | 2 | (3) | 5 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | 7.000 | 24 | 3 | 21 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 3.400 | (3) | (22) | 19 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 6.400 | (25) | (85) | 60 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 12.400 | (77) | (76) | (1) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BPS | 2.000 | (2) | (17) | 15 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BPS | 6.400 | (40) | (36) | (4) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | BRC | 900 | (2) | (10) | 8 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 5.700 | (22) | (95) | 73 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | CBK | 1.000 | (1) | (7) | 6 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 8.300 | (7) | (22) | 15 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 1.000 | (4) | (21) | 17 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 1.700 | (10) | (36) | 26 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 9.300 | (8) | (30) | 22 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 7.600 | (6) | (22) | 16 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 3.600 | (5) | (30) | 25 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.071) | $ (749) | $ (322) | (0,04) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR abzgl. 0,106 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | JPM | TRY 78.780 | $ 27.003 | $ (306) | $ (44) | $ (262) | (0,01) |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,370 % | 17.08.2016 | JPM | MYR 208.200 | $ (159) | $ 70 | $ (229) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,175 % | 09.07.2017 | BRC | 3.000 | (8) | 0 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,175 % | 09.07.2017 | CBK | 4.500 | (12) | 0 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,175 % | 09.07.2017 | DUB | 11.500 | (30) | 0 | (30) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,360 % | 17.04.2018 | CBK | 55.540 | (155) | 0 | (155) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,330 % | 19.04.2018 | JPM | 35.070 | (104) | 0 | (104) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,335 % | 19.04.2018 | DUB | 28.225 | (83) | 0 | (83) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,325 % | 24.04.2018 | CBK | 24.600 | (74) | 0 | (74) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,160 % | 22.07.2020 | BOA | 17.200 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,170 % | 27.07.2020 | BOA | 25.100 | 47 | (2) | 49 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,020 % | 20.09.2020 | DUB | 21.900 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 4,260 % | 02.11.2020 | JPM | 12.400 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| Zahlung | 3-MonthZAR-SAJIBOR | 6,500 % | 16.11.2016 | CBK | ZAR 224.500 | (103) | (63) | (40) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 19.06.2018 | GST | 56.600 | (69) | (14) | (55) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,250 % | 18.12.2018 | BRC | 72.700 | (156) | 2 | (158) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,250 % | 18.12.2018 | GST | 36.300 | (78) | (11) | (67) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 17.12.2019 | BRC | 201.600 | (559) | 68 | (627) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,750 % | 17.12.2019 | GST | 350.000 | (780) | 101 | (881) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,750 % | 17.12.2019 | HUS | 445.300 | (992) | 150 | (1.142) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 6,500 % | 20.03.2020 | BRC | 25.300 | (132) | 8 | (140) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,545 % | 17.09.2020 | BRC | 83.000 | (286) | (5) | (281) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 19.06.2023 | HUS | 183.500 | (1.14 | (308) | (833) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 8,000 % | 19.06.2023 | JPM | 71.800 | (321) | (81) | (240) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,750 % | 18.12.2023 | JPM | 135.300 | (774) | (14) | (760) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 17.12.2024 | GLM | 94.734 | (706) | (49) | (657) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 8,500 % | 16.09.2030 | GST | 89.900 | (520) | 66 | (586) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 8,500 % | 16.03.2031 | CBK | 123.300 | (765) | (127) | (638) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month PLN-WIBOR | 4,650 % | 16.11.2016 | CBK | PLN 11.300 | 84 | (2) | 86 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,480 % | 19.08.2016 | JPM | THB 1.970.800 | 1.0 | 70 | 985 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,350 % | 08.11.2018 | DUB | 52.000 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,340 % | 11.11.2018 | DUB | 38.000 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,320 % | 12.11.2018 | BOA | THB 48.000 | $ 59 | $ 0 | $ 59 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,390 % | 13.11.2018 | BOA | 43.000 | 55 | (1) | 56 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,370 % | 14.11.2018 | DUB | 35.000 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,260 % | 18.12.2019 | HUS | 1.431.500 | 379 | 0 | 379 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,320 % | 27.07.2020 | BOA | 417.700 | 708 | 0 | 708 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,320 % | 29.07.2020 | JPM | 131.800 | 222 | 0 | 222 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,015 % | 17.08.2020 | DUB | 86.000 | (6) | 0 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,040 % | 17.08.2020 | HUS | 320.000 | (13) | 0 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,220 % | 23.11.2020 | AZD | 39.800 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,520 % | 13.01.2021 | CBK | 68.600 | 138 | 0 | 138 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,480 % | 14.01.2021 | BPS | 4.300 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,490 % | 14.01.2021 | BOA | 450.000 | 909 | 0 | 909 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,410 % | 15.01.2021 | CBK | 105.700 | 201 | 0 | 201 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,410 % | 15.01.2021 | DUB | 105.700 | 196 | 0 | 196 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,420 % | 17.01.2021 | CBK | 328.450 | 629 | 0 | 629 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,410 % | 21.01.2021 | DUB | 100.550 | 191 | 0 | 191 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,415 % | 21.01.2021 | BPS | 104.710 | 199 | 0 | 199 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,385 % | 23.01.2021 | BPS | 139.200 | 258 | 0 | 258 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 3,390 % | 23.01.2021 | DUB | 139.000 | 259 | 0 | 259 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,625 % | 27.07.2025 | CBK | 200.600 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,780 % | 23.09.2025 | FBF | 20.740 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,810 % | 23.09.2025 | CBK | 409.080 | 207 | 0 | 207 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Thailand Fixing Rate | 2,580 % | 19.10.2025 | DUB | 470.200 | (43) | 0 | (43) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2016 | BOA | BRL 122.300 | (172) | (6) | (166) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,680 % | 01.04.2016 | BPS | 284.600 | (246) | (48) | (198) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,770 % | 01.04.2016 | HUS | 213.300 | (154) | 0 | (154) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,220 % | 02.01.2017 | MYC | 292.100 | (9.425) | (365) | (9.060) | (0,37) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,365 % | 02.01.2017 | DUB | 365.500 | (11.156) | 0 | (11.156) | (0,44) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,420 % | 02.01.2017 | BOA | 363.000 | (11.003) | 223 | (11.226) | (0,43) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,640 % | 02.01.2017 | MYC | 62.700 | (1.705) | 394 | (2.099) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,650 % | 02.01.2017 | UAG | 10.300 | (296) | 18 | (314) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,910 % | 02.01.2017 | BOA | 116.300 | (3.083) | 118 | (3.201) | (0,12) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 10,910 % | 02.01.2017 | BOA | 297.400 | 3.637 | 1.198 | 2.439 | 0,14 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | BPS | 735.200 | 4.328 | (1) | 4.329 | 0,17 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | DUB | 194.800 | 1.147 | (272) | 1.419 | 0,04 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | FBF | 101.900 | 600 | (5) | 605 | 0,02 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | GLM | 300.300 | 1.768 | (142) | 1.910 | 0,07 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | HUS | 231.500 | 1.363 | 174 | 1.189 | 0,05 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | MYC | 153.600 | 904 | (144) | 1.048 | 0,04 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,820 % | 02.01.2017 | HUS | 310.100 | 1.312 | (12) | 1.324 | 0,05 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | GLM | 52.400 | (209) | (32) | (177) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | DUB | 86.900 | (50) | 5 | (55) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | HUS | 123.100 | (72) | 12 | (84) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,610 % | 02.01.2018 | BOA | 70.300 | (1.451) | (280) | (1.171) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,610 % | 02.01.2018 | BPS | 78.500 | (1.621) | (203) | (1.418) | (0,07) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,610 % | 02.01.2018 | DUB | 57.500 | (1.187) | (94) | (1.093) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,610 % | 02.01.2018 | JPM | 49.500 | (1.022) | (72) | (950) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,610 % | 02.01.2018 | UAG | 53.400 | (1.103) | (142) | (961) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | CBK | 64.600 | (1.138) | (228) | (910) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | BPS | 239.130 | (3.872) | (504) | (3.368) | (0,15) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | MYC | 7.300 | (118) | (12) | (106) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,860 % | 02.01.2018 | JPM | 112.600 | 1.558 | 0 | 1.558 | 0,06 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,985 % | 02.01.2018 | BPS | 25.800 | (333) | 0 | (333) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,375 % | 02.01.2018 | MYC | 123.700 | (1.413) | (1) | (1.412) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | GLM | 97.500 | (967) | (26) | (941) | (0,04) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | GLM | 188.500 | 507 | 476 | 31 | 0,02 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | JPM | 89.600 | 241 | 229 | 12 | 0,01 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,590 % | 02.01.2018 | DUB | 177.500 | (81) | 0 | (81) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | BPS | 153.400 | (440) | 2 | (442) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | BRC | 80.600 | (231) | (18) | (213) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | DUB | 114.800 | (329) | (72) | (257) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | GLM | 554.900 | (1.592) | (80) | (1.512) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | JPM | 174.900 | (502) | (301) | (201) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | MYC | 115.300 | (331) | (96) | (235) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 11,000 % | 04.01.2021 | BPS | 34.300 | 1.384 | 89 | 1.295 | 0,06 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | DUB | 31.200 | (925) | (13) | (912) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | HUS | 158.200 | (4.690) | (60) | (4.630) | (0,18) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 1.100 | (31) | (2) | (29) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BPS | 20.700 | (577) | (20) | (557) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | HUS | 15.000 | (418) | (16) | (402) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,800 % | 04.01.2021 | HUS | 36.300 | (888) | (82) | (806) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | FBF | 18.700 | (456) | 49 | (505) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | BPS | 93.300 | (1.959) | (607) | (1.352) | (0,08) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | DUB | 85.680 | (1.799) | (812) | (987) | (0,07) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | GLM | 40.200 | (844) | 93 | (937) | (0,03) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,310 % | 04.01.2021 | DUB | 38.500 | 784 | 0 | 784 | 0,03 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,320 % | 04.01.2021 | MYC | 99.400 | 2.017 | 0 | 2.017 | 0,08 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,345 % | 04.01.2021 | BRC | 80.300 | 1.615 | 0 | 1.615 | 0,06 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,445 % | 04.01.2021 | BPS | 112.140 | (649) | 0 | (649) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | BPS | 56.850 | (274) | 77 | (351) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | HUS | 229.500 | 429 | 90 | 339 | 0,02 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,395 % | 04.01.2021 | BPS | BRL 116.900 | $ 50,36 | $ 0 | $ 50,6 | 0,00 |
| Zahlung | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 5,310 % | 29.08.2019 | BOA | COP 13.850.000 | (174) | 0 | (174) | (0,01) |
| Zahlung | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 4,795 % | 03.03.2020 | MYC | 13.765.000 | (288) | 0 | (288) | (0,01) |
| Zahlung | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 5,230 % | 28.05.2020 | JPM | 12.870.000 | (218) | 0 | (218) | (0,01) |
| Zahlung | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,220 % | 28.05.2025 | BOA | 15.860.000 | (389) | 0 | (389) | (0,02) |
| Erhalt | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,430 % | 01.07.2025 | GLM | 9.970.000 | 177 | 0 | 177 | 0,01 |
| Erhalt | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,445 % | 01.07.2025 | DUB | 10.000.000 | 191 | 0 | 191 | 0,01 |
| Erhalt | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,420 % | 02.07.2025 | HUS | 6.140.000 | 121 | 0 | 121 | 0,00 |
| Erhalt | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,420 % | 02.07.2025 | JPM | 2.620.000 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| Erhalt | Colombia IBR Overnight Interbank Reference Rate | 6,420 % | 02.07.2025 | MYC | 13.740.000 | 271 | 0 | 271 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,210 % | 21.10.2020 | UAG | MXN 308.800 | (207) | 0 | (207) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,350 % | 01.09.2023 | FBF | 70.000 | 71 | 6 | 65 | 0,00 |
| | | | | | | $ (47.542) | $ (1.657) | $ (45.885) | (1,85) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 17.808 | $ | 4.595 | BOA | $ 94 | $ 0 | $ 94 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.561 | BRL | 17.808 | BOA | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 606.141 | $ | 165.077 | BPS | 11.866 | 0 | 11.866 | 0,46 |
| 01/2016 | $ | 160.452 | BRL | 606.141 | BPS | 0 | (7.241) | (7.241) | (0,28) |
| 01/2016 | BRL | 757.832 | $ | 205.860 | DUB | 14.307 | 0 | 14.307 | 0,56 |
| 01/2016 | $ | 200.687 | BRL | 757.832 | DUB | 0 | (9.134) | (9.134) | (0,36) |
| 01/2016 | BRL | 17.692 | $ | 4.533 | FBF | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.554 | BRL | 17.692 | FBF | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| 01/2016 | | 113.324 | | 442.386 | GLM | 0 | (1.504) | (1.504) | (0,06) |
| 01/2016 | BRL | 442.386 | $ | 148.546 | GLM | 36.727 | 0 | 36.727 | 1,43 |
| 01/2016 | $ | 216.050 | BRL | 843.632 | HUS | 0 | (2.810) | (2.810) | (0,11) |
| 01/2016 | BRL | 843.632 | $ | 211.066 | HUS | 0 | (2.174) | (2.174) | (0,08) |
| 01/2016 | | 97.457 | | 24.941 | JPM | 307 | 0 | 307 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 25.442 | BRL | 97.457 | JPM | 0 | (809) | (809) | (0,03) |
| 01/2016 | | 74.456 | | 298.382 | UAG | 964 | 0 | 964 | 0,04 |
| 01/2016 | BRL | 298.382 | $ | 76.414 | UAG | 994 | 0 | 994 | 0,04 |
| 01/2016 | CNH | 12.004 | | 1.872 | CBK | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 145 | CNH | 957 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.873 | | 12.004 | UAG | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| 01/2016 | | 25.100 | CNY | 163.853 | BOA | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| 01/2016 | | 237 | | 1.545 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CNY | 93.862 | $ | 14.341 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 163.803 | | 25.100 | JPM | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 50 | € | 46 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 16 | | 15 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 156 | | 143 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 2 | $ | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | £ | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 65.759 | INR | 4.325.542 | BOA | 0 | (553) | (553) | (0,02) |
| 01/2016 | INR | 894.492 | $ | 13.469 | CBK | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | | 601.554 | | 9.156 | DUB | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| 01/2016 | | 25.794 | | 388 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 17.921 | | 269 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 63.476 | | 950 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.941 | JPY | 238.087 | BOA | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 238.087 | $ | 1.949 | GLM | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 3.217.781 | | 2.806 | CBK | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.701.272 | | 2.352 | DUB | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.335 | KRW | 1.570.082 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 8.881.672 | $ | 7.598 | JPM | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.976.738 | | 1.724 | RYL | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 15.214 | | 3.543 | BOA | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 383 | MYR | 1.633 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 6.994 | $ | 1.627 | BRC | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 19.249 | | 4.528 | DUB | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.609 | MYR | 6.907 | DUB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 6.368 | $ | 1.473 | GLM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 57.289 | | 13.780 | SCX | 499 | 0 | 499 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 84.802 | MYR | 371.801 | SCX | 1.391 | (4) | 1.387 | 0,05 |
| 01/2016 | MYR | 28.607 | $ | 6.685 | SOG | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.117 | | 4.363 | UAG | 164 | 0 | 164 | 0,01 |
| 01/2016 | PEN | 13.990 | | 4.264 | BOA | 163 | 0 | 163 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 4.132 | PEN | 13.990 | FBF | $ 0 | $ (32) | $ (32) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.235 | PHP | 105.203 | DUB | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 118.757 | $ | 1.667 | BPS | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.767 | RUB | 711.098 | DUB | 0 | (1.075) | (1.075) | (0,04) |
| 01/2016 | | 3.677 | | 241.053 | FBF | 0 | (392) | (392) | (0,01) |
| 01/2016 | | 7.875 | | 522.608 | GLM | 0 | (752) | (752) | (0,03) |
| 01/2016 | | 2.096 | | 132.303 | GLM | 0 | (298) | (298) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 74.733 | $ | 1.056 | GLM | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.214 | RUB | 265.753 | JPM | 0 | (603) | (603) | (0,02) |
| 01/2016 | | 1.558 | | 108.309 | MSB | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.553 | | 761.683 | SOG | 0 | (1.172) | (1.172) | (0,05) |
| 01/2016 | RUB | 1.792.710 | $ | 27.224 | SOG | 2.791 | 0 | 2.791 | 0,11 |
| 01/2016 | | 477.308 | | 7.271 | UAG | 766 | 0 | 766 | 0,03 |
| 01/2016 | TRY | 17.826 | | 6.038 | BOA | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| 01/2016 | | 28.767 | | 9.822 | BRC | 13 | (3) | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | | 16.139 | | 5.438 | CBK | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.944 | TRY | 23.555 | CBK | 90 | 0 | 90 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 19.037 | $ | 6.518 | DUB | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.637 | | 1.217 | GLM | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.253 | TRY | 3.674 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 17.466 | $ | 5.969 | HUS | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.765 | | 941 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 83.648 | TRY | 246.878 | SCX | 560 | 0 | 560 | 0,02 |
| 02/2016 | BRL | 5.788 | $ | 1.416 | BOA | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.655 | BRL | 6.550 | CBK | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 33.660 | $ | 8.348 | CBK | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.900 | | 975 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 208.866 | BRL | 843.632 | HUS | 2.209 | 0 | 2.209 | 0,09 |
| 02/2016 | | 8.342 | | 33.660 | MSB | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 82.076.454 | $ | 27.513 | BPS | 1.860 | (97) | 1.763 | 0,07 |
| 02/2016 | | 40.187.986 | | 13.551 | BRC | 952 | (10) | 942 | 0,04 |
| 02/2016 | | 2.492.597 | | 779 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.127 | COP | 9.862.014 | CBK | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 5.848.497 | $ | 1.809 | GLM | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.124.296 | | 1.536 | HUS | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| 02/2016 | | 90.871 | | 28 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 15.379 | | 16.552 | CBK | 0 | (170) | (170) | (0,01) |
| 02/2016 | | 21.363 | | 23.276 | GLM | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.851 | € | 13.749 | NAB | 99 | 0 | 99 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 171 | $ | 184 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 10.074 | | 15.216 | HUS | 367 | 0 | 367 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 12.480 | IDR | 179.936.976 | AZD | 339 | (7) | 332 | 0,01 |
| 02/2016 | IDR | 21.542.285 | $ | 1.502 | BRC | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| 02/2016 | | 45.166.680 | | 3.217 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 40.534.776 | | 2.890 | HUS | 8 | (4) | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.959 | IDR | 126.361.345 | HUS | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 34.606.308 | $ | 2.454 | JPM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 16.021 | IDR | 224.787.360 | SCX | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 138.108.600 | $ | 9.492 | SOG | 0 | (342) | (342) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 323 | IDR | 4.602.109 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | | 166 | ILS | 641 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 93.301 | $ | 24.090 | MSB | 93 | 0 | 93 | 0,00 |
| 02/2016 | | 12.890 | | 3.309 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 23.464 | INR | 1.586.403 | BRC | 323 | 0 | 323 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 238.087 | $ | 1.942 | BOA | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.910.000 | | 64.558 | BPS | 0 | (1.265) | (1.265) | (0,05) |
| 02/2016 | | 1.300.000 | | 10.603 | CBK | 0 | (215) | (215) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 3.814 | JPY | 469.300 | JPM | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.516 | MYR | 38.967 | CBK | 0 | (485) | (485) | (0,02) |
| 02/2016 | NGN | 126.968 | $ | 496 | BRC | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.229.633 | | 12.986 | CBK | 0 | (1.979) | (1.979) | (0,08) |
| 02/2016 | $ | 9.565 | NGN | 2.497.707 | HUS | 2.009 | 0 | 2.009 | 0,08 |
| 02/2016 | | 3.342 | | 858.894 | JPM | 638 | 0 | 638 | 0,03 |
| 02/2016 | | 5.485 | RUB | 376.920 | JPM | 0 | (388) | (388) | (0,01) |
| 02/2016 | | 226 | SGD | 319 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 12.787 | $ | 9.029 | NGF | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| 02/2016 | | 39.995 | | 28.409 | SCX | 265 | 0 | 265 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 107.084 | THB | 3.844.313 | BOA | 0 | (400) | (400) | (0,02) |
| 02/2016 | | 1.609 | | 58.173 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 68.719 | $ | 1.895 | HUS | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.065 | THB | 38.319 | JPM | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 288.791 | $ | 7.954 | JPM | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| 02/2016 | | 52.573 | | 1.449 | MSB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 6.038 | THB | 217.006 | UAG | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 299.773 | $ | 9.175 | GLM | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 496 | TWD | 16.336 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 1.720.787 | $ | 52.777 | JPM | 633 | 0 | 633 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 448 | TWD | 14.676 | MSB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 146.023 | $ | 4.452 | MSB | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | | 290.022 | | 8.762 | SOG | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 03/2016 | CZK | 12.000 | | 479 | MSB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 848 | HUF | 246.717 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 03/2016 | HUF | 93.778 | $ | 326 | HUS | $ 4 | $ 0 | $ 4 | 0,00 |
| 03/2016 | | 204.934 | | 710 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 03/2016 | | 86.404 | | 298 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 202.351 | | 11.734 | BOA | 84 | (8) | 76 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 3.940 | MXN | 67.901 | BRC | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 39.062 | $ | 2.258 | CBK | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 03/2016 | | 57.367 | | 3.356 | GLM | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 164.274 | MXN | 2.817.532 | GLM | 0 | (1.955) | (1.955) | (0,08) |
| 03/2016 | | 697 | | 11.895 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 119.875 | $ | 6.978 | UAG | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| 03/2016 | PEN | 24.018 | | 7.017 | BRC | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 14.621 | PEN | 49.023 | BRC | 0 | (400) | (400) | (0,02) |
| 03/2016 | PEN | 770 | $ | 223 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | | 3.952 | | 1.159 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 03/2016 | | 13.990 | | 4.085 | FBF | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 03/2016 | | 2.578 | | 754 | HUS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 9.876 | | 2.542 | BPS | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 03/2016 | | 8.715 | | 2.208 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 9.308 | PLN | 36.877 | GLM | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 35.412 | $ | 9.033 | MSB | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| 03/2016 | | 6.503 | | 1.659 | SOG | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 03/2016 | RON | 1.518 | | 365 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 743 | | 179 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 100.287 | | 24.334 | SOG | 237 | 0 | 237 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 22.340 | RUB | 1.590.822 | BOA | 0 | (1.034) | (1.034) | (0,04) |
| 03/2016 | | 12.019 | | 872.581 | DUB | 0 | (333) | (333) | (0,01) |
| 03/2016 | | 835 | | 62.324 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | RUB | 82.311 | $ | 1.125 | HUS | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| 03/2016 | | 59.033 | | 787 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 76 | RUB | 5.677 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 12.515 | | 911.402 | SCX | 0 | (309) | (309) | (0,01) |
| 03/2016 | | 1.356 | ZAR | 21.448 | BOA | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 20.393 | $ | 1.294 | BPS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 03/2016 | | 27.156 | | 1.766 | BRC | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| 03/2016 | | 48.094 | | 3.133 | CBK | 72 | (2) | 70 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 609 | ZAR | 9.244 | DUB | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 36.321 | $ | 2.316 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 03/2016 | | 26.033 | | 1.712 | HUS | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 4.112 | ZAR | 62.985 | JPM | 3 | (104) | (101) | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 568.879 | $ | 36.708 | MSB | 479 | 0 | 479 | 0,02 |
| 04/2016 | BRL | 41.900 | | 10.480 | DUB | 211 | 0 | 211 | 0,01 |
| 04/2016 | $ | 13.365 | BRL | 53.600 | JPM | 0 | (229) | (229) | (0,01) |
| 04/2016 | BRL | 264.000 | $ | 82.610 | JPM | 17.913 | 0 | 17.913 | 0,70 |
| 04/2016 | | 66.000 | | 20.673 | NGF | 4.499 | 0 | 4.499 | 0,18 |
| 04/2016 | $ | 2.243 | CLP | 1.595.167 | HUS | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 04/2016 | CZK | 40.000 | $ | 1.598 | JPM | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 81.044 | | 1.118 | MSB | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 04/2016 | | 74.733 | | 1.031 | SOG | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 156.601 | | 44.426 | JPM | 6.408 | 0 | 6.408 | 0,25 |
| 05/2016 | $ | 15.839 | HUF | 4.571.755 | CBK | 0 | (152) | (152) | (0,01) |
| 05/2016 | | 20.635 | | 6.057.763 | GLM | 150 | 0 | 150 | 0,01 |
| 05/2016 | | 84.715 | PLN | 336.344 | DUB | 269 | 0 | 269 | 0,01 |
| 05/2016 | | 96.454 | | 384.120 | UAG | 601 | 0 | 601 | 0,02 |
| 05/2016 | | 59.131 | ZAR | 887.556 | BOA | 0 | (3.227) | (3.227) | (0,13) |
| 05/2016 | | 336 | | 4.914 | CBK | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 05/2016 | | 9.470 | | 140.617 | DUB | 0 | (613) | (613) | (0,02) |
| 05/2016 | | 104.581 | | 1.553.398 | JPM | 0 | (6.738) | (6.738) | (0,26) |
| 05/2016 | | 50.724 | | 753.579 | SCX | 0 | (3.259) | (3.259) | (0,13) |
| 07/2016 | BRL | 245.755 | $ | 62.200 | BPS | 3.732 | 0 | 3.732 | 0,15 |
| 07/2016 | | 48.123 | | 12.300 | HUS | 851 | 0 | 851 | 0,03 |
| 07/2016 | | 14.800 | | 3.594 | JPM | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| 08/2016 | $ | 26.685 | IDR | 419.547.502 | AZD | 1.938 | 0 | 1.938 | 0,08 |
| 08/2016 | | 6.462 | | 102.255.469 | CBK | 515 | 0 | 515 | 0,02 |
| 08/2016 | | 4.958 | | 79.462.766 | JPM | 463 | 0 | 463 | 0,02 |
| 08/2016 | | 15.679 | | 249.943.987 | SCX | 1.374 | 0 | 1.374 | 0,05 |
| 09/2016 | CNH | 12.004 | $ | 1.819 | BPS | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| 09/2016 | | 72.670 | | 11.030 | BRC | 257 | 0 | 257 | 0,01 |
| 09/2016 | | 52.927 | | 8.030 | HUS | 184 | 0 | 184 | 0,01 |
| 09/2016 | | 89.499 | | 13.540 | JPM | 283 | 0 | 283 | 0,01 |
| 09/2016 | | 43.388 | | 6.560 | JPM | 131 | 0 | 131 | 0,01 |
| 09/2016 | CZK | 145.218 | | 6.053 | HUS | 138 | 0 | 138 | 0,01 |
| 09/2016 | | 13.030 | | 545 | SOG | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 09/2016 | $ | 1.519 | RUB | 116.406 | JPM | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 42.300 | $ | 10.087 | BPS | 335 | 0 | 335 | 0,01 |
| 10/2016 | $ | 11.301 | BRL | 49.159 | BPS | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 42.100 | $ | 9.910 | CBK | 203 | 0 | 203 | 0,01 |
| 10/2016 | | 78.512 | | 21.597 | DUB | 3.496 | 0 | 3.496 | 0,14 |
| 10/2016 | | 49.086 | | 11.301 | GLM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 83.237 | | 12.781 | JPM | 476 | 0 | 476 | 0,02 |
| 10/2016 | | 70.510 | | 10.898 | SCX | 474 | 0 | 474 | 0,02 |
| 10/2016 | CZK | 106.084 | | 4.274 | CBK | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| 12/2016 | $ | 5.571 | RUB | 395.395 | CBK | 0 | (603) | (603) | (0,02) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2017 | BRL | 157.600 | $ | 36.638 | BPS | $ 1.244 | $ 0 | $ 1.244 | 0,05 |
| 07/2017 | | 58.300 | | 20.548 | BPS | 8.210 | 0 | 8.210 | 0,32 |
| | | | | | | $ 138.691 | $ (54.248) | $ 84.443 | 3,29 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 33.348** | **1,30** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.551.737** | **99,32** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 4 | $ 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 308 | 454 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 53 | 53 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 128 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.463 | 1.463 | 0,06 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 21 | 21 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 7 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 16 | 16 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 873 | 56 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 456 | 456 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 425 | 425 | 0,02 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 600 | 77 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 4.065 | 262 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 439 | 439 | 0,02 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 3 | 2 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 12 | 8 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 515 | 560 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 97 | 143 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 54 | 1 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 10 | 10 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 4.456** | **0,17** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 12.959** | **0,51** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 2.569.152** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(b) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(c) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 668 und Barmittel in Höhe von USD 39.595 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 891 und Barmittel von USD 9.225 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(f) Beschränkt übertragbare Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Malaysia Government International Bond | 4,837 % | 15.07.2025 | 25.07.2014 | $ 135 | $ 97 | 0,00 |

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 187.273 | $ 2.332.031 | $ 6.625 | $ 2.525.929 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 25.808 | 0 | 25.808 |
| **Summen** | **$ 187.273** | **$ 2.357.839** | **$ 6.625** | **$ 2.551.737** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 447.770 | $ 3.952.552 | $ 2.059 | $ 4.402.381 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 44.171 | 0 | 44.171 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (75.903) | 0 | (75.903) |
| **Summen** | **$ 447.770** | **$ 3.920.820** | **$ 2.059** | **$ 4.370.649** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(h) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 2.275 | $ (2.520) | $ (245) |
| BOA | (16.818) | 17.493 | 675 |
| BPS | 15.257 | (13.969) | 1.288 |
| BRC | 1.185 | (1.300) | (115) |
| CBK | (4.059) | 3.520 | (539) |
| DUB | (6.124) | 1.785 | (4.339) |
| FBF | 332 | (139) | 193 |
| GLM | 30.741 | (31.790) | (1.049) |
| GST | (1.820) | 1.521 | (299) |
| HUS | (4.231) | 1.152 | (3.079) |
| JPM | 17.480 | (17.290) | 190 |
| MSB | 692 | (710) | (18) |
| MYC | (10.063) | 9.842 | (221) |
| NAB | 99 | (300) | (201) |
| NGF | 4.206 | (4.179) | 27 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| RYL | 43 | 0 | 43 |
| SCX | 979 | (1.000) | (21) |
| SOG | 1.343 | (1.340) | 3 |
| UAG | 1.832 | (3.280) | (1.448) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(i) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,32 | 97,42 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,30) | (0,23) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,30 | (1,45) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,98 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Local Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 55.428.537 | $ 554.700 |
| | | PARI (000S) | |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 430.300 | 124.909 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.04.2016 | | 371.900 | 111.518 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 193.100 | 59.281 |
| Poland Government International Bond 1,500 % fällig am 25.04.2020 | PLN | 199.300 | 50.677 |
| Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 11.06.2020 | MXN | 586.000 | 45.814 |
| South Africa Government International Bond 8,250 % fällig am 31.03.2032 | ZAR | 520.600 | 40.353 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 157.600 | 35.313 |
| Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 124.100 | 34.759 |
| Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2024 | IDR | 385.779.000 | 33.541 |
| South Africa Government International Bond 8,250 % fällig am 15.09.2017 | ZAR | 326.300 | 28.001 |
| Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 25.07.2019 | PLN | 94.800 | 26.890 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 91.000 | 25.835 |
| Turkey Government International Bond 8,000 % fällig am 12.03.2025 | TRY | 73.189 | 25.526 |
| Malaysia Government International Bond 3,795 % fällig am 30.09.2022 | MYR | 105.760 | 24.929 |
| Turkey Government International Bond 7,400 % fällig am 05.02.2020 | TRY | 70.500 | 24.181 |
| Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 283.804.000 | 23.955 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 15.07.2015 | $ | 21.500 | 21.497 |
| Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 13.12.2018 | MXN | 311.000 | 21.030 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 84.400 | 19.578 |
| South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 286.300 | 17.820 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 82.443.748 | $ 825.000 |
| | | PARI (000S) | |
| South Africa Government International Bond 7,250 % fällig am 15.01.2020 | ZAR | 1.757.700 | 141.302 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 613.200 | 141.281 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 526.160 | 119.363 |
| South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 21.12.2018 | ZAR | 931.500 | 76.927 |
| Poland Government International Bond 2,500 % fällig am 25.07.2018 | PLN | 235.000 | 62.942 |
| Poland Government International Bond 5,500 % fällig am 25.10.2019 | | 187.284 | 58.428 |
| Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2024 | IDR | 733.713.000 | 55.902 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 174.500 | 51.531 |
| Federal Home Loan Bank 0,050 % fällig am 12.02.2015 | $ | 49.400 | 49.398 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 7,000 % fällig am 31.01.2016 | RUB | 3.048.100 | 47.103 |
| Federal Home Loan Bank 0,150 % fällig am 09.04.2015 | $ | 46.000 | 45.993 |
| Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 157.700 | 44.208 |
| Indonesia Government International Bond 9,500 % fällig am 15.07.2031 | IDR | 552.794.000 | 42.276 |
| Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 11.06.2020 | MXN | 586.000 | 42.053 |
| Turkey Government International Bond 3,000 % fällig am 06.01.2021 | TRY | 101.656 | 39.210 |
| Federal Home Loan Bank 0,042 % fällig am 28.01.2015 | $ | 36.200 | 36.199 |
| Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A. 8,700 % fällig am 17.03.2016 | RUB | 2.118.000 | 35.780 |
| Turkey Government International Bond 10,500 % fällig am 15.01.2020 | TRY | 79.380 | 32.829 |
| South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 | ZAR | 314.344 | 32.087 |

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **BRASILIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Banco Daycoval S.A.** | | | |
| 5,750 % fällig am 19.03.2019 (a) | $ 500 | $ 483 | 0,94 |
| **Caixa Economica Federal** | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | 2.030 | 1.875 | 3,64 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | 2.820 | 2.517 | 4,88 |
| | | 4.875 | 9,46 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | 1.820 | 1.797 | 3,49 |
| Summe Brasilien | | 6.672 | 12,95 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | |
| **Road King Infrastructure Finance 2012 Ltd.** | | | |
| 9,875 % fällig am 18.09.2017 | 400 | 420 | 0,81 |
| **CAYMAN INSELN** | | | |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | 1.400 | 1.219 | 2,36 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | |
| 6,500 % fällig am 04.06.2018 | 700 | 688 | 1,34 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | |
| 12,250 % fällig am 15.04.2018 | 700 | 759 | 1,47 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 9,375 % fällig am 05.04.2018 | 700 | 740 | 1,44 |
| | | 3.406 | 6,61 |
| **CHILE** | | | |
| **Celulosa Arauco y Constitucion S.A.** | | | |
| 7,250 % fällig am 29.07.2019 | 400 | 450 | 0,87 |
| **GABUN** | | | |
| **Gabon Government International Bond** | | | |
| 8,200 % fällig am 12.12.2017 | 1.350 | 1.361 | 2,64 |
| **HONGKONG** | | | |
| **China Overseas Finance Cayman III Ltd.** | | | |
| 3,375 % fällig am 29.10.2018 | 1.100 | 1.112 | 2,16 |
| **Franshion Brilliant Ltd.** | | | |
| 5,750 % fällig am 19.03.2019 | 830 | 887 | 1,72 |
| | | 1.999 | 3,88 |
| **UNGARN** | | | |
| **Magyar Export-Import Bank Zrt** | | | |
| 5,500 % fällig am 12.02.2018 | 1.130 | 1.195 | 2,32 |
| **INDIEN** | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | |
| 3,875 % fällig am 02.10.2019 | 800 | 824 | 1,60 |
| **Oil India Ltd.** | | | |
| 3,875 % fällig am 17.04.2019 | 700 | 717 | 1,39 |
| | | 1.541 | 2,99 |
| **INDONESIEN** | | | |
| **Listrindo Capital BV** | | | |
| 6,950 % fällig am 21.02.2019 | $ 900 | $ 925 | 1,80 |
| **Majapahit Holding BV** | | | |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | 1.700 | 1.908 | 3,70 |
| **TBG Global Pte Ltd.** | | | |
| 4,625 % fällig am 03.04.2018 | 900 | 882 | 1,71 |
| | | 3.715 | 7,21 |
| **IRLAND** | | | |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | 1.550 | 1.699 | 3,30 |
| **ISRAEL** | | | |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | |
| 5,625 % fällig am 21.06.2018 | 2.430 | 2.571 | 4,99 |
| **KASACHSTAN** | | | |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | |
| 9,125 % fällig am 02.07.2018 | 2.250 | 2.483 | 4,82 |
| **Samruk-Energy JSC** | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | 1.700 | 1.666 | 3,23 |
| **Zhaikmunai LLP** | | | |
| 6,375 % fällig am 14.02.2019 | 600 | 472 | 0,92 |
| | | 4.621 | 8,97 |
| **KENIA** | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | |
| 5,875 % fällig am 24.06.2019 | 1.400 | 1.326 | 2,58 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | 1.650 | 1.782 | 3,46 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | 1.740 | 1.753 | 3,40 |
| **Topaz Marine S.A.** | | | |
| 8,625 % fällig am 01.11.2018 | 700 | 644 | 1,25 |
| | | 4.179 | 8,11 |
| **MARSHALLINSELN** | | | |
| **Millennium Offshore Services Superholdings LLC** | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2018 | 300 | 273 | 0,53 |
| **MEXIKO** | | | |
| **Cemex SAB de C.V.** | | | |
| 9,500 % fällig am 15.06.2018 | 800 | 856 | 1,66 |
| **NIGERIA** | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | |
| 5,125 % fällig am 12.07.2018 | 1.130 | 1.081 | 2,10 |
| **PERU** | | | |
| **Corporation Financiera de Desarrollo S.A.** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | 1.000 | 999 | 1,94 |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | |
| 3,375 % fällig am 02.04.2019 | 1.300 | 1.300 | 2,52 |
| | | 2.299 | 4,46 |
| **RUSSLAND** | | | |
| **SCF Capital Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 27.10.2017 | $ 800 | $ 795 | 1,54 |
| **Sibur Securities Ltd.** | | | |
| 3,914 % fällig am 31.01.2018 | 700 | 682 | 1,32 |
| | | 1.477 | 2,86 |
| **SRI LANKA** | | | |
| **Bank of Ceylon** | | | |
| 5,325 % fällig am 16.04.2018 | 400 | 388 | 0,75 |
| **National Savings Bank** | | | |
| 8,875 % fällig am 18.09.2018 | 600 | 619 | 1,20 |
| | | 1.007 | 1,95 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | |
| **African Export-Import Bank** | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2018 | 1.400 | 1.403 | 2,72 |
| **TÜRKEI** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **AK Finansal Kiralama** | | | |
| 4,125 % fällig am 17.04.2018 | 1.400 | 1.391 | 2,70 |
| **Turkiye Garanti Bankasi** | | | |
| 4,750 % fällig am 17.10.2019 | 1.400 | 1.395 | 2,71 |
| **Turkiye Is Bankasi** | | | |
| 3,750 % fällig am 10.10.2018 | 1.400 | 1.377 | 2,67 |
| **Turkiye Vakiflar Bankasi Tao** | | | |
| 5,000 % fällig am 31.10.2018 (a) | 1.400 | 1.417 | 2,75 |
| | | 5.580 | 10,83 |
| Summe Türkei | | 5.580 | 10,83 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **Vedanta Resources PLC** | | | |
| 9,500 % fällig am 18.07.2018 (a) | 950 | 708 | 1,38 |
| **USA** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,155 % fällig am 26.01.2016 | 500 | 500 | 0,97 |
| 0,160 % fällig am 29.01.2016 | 100 | 100 | 0,19 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,150 % fällig am 10.02.2016 | 500 | 500 | 0,97 |
| 0,170 % fällig am 28.01.2016 | 100 | 100 | 0,20 |
| 0,230 % fällig am 13.01.2016 | 200 | 200 | 0,39 |
| | | 1.400 | 2,72 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (b)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 179.976 | 1.800 | 3,49 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 53.039** | **102,93** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | HUS | $ 200 | $ (4) | $ (4) | $ 0 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | BPS | 500 | (6) | (7) | 1 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2018 | GST | 500 | (4) | 1 | (5) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 200 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | JPM | 750 | (3) | (3) | 0 | (0,01) |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | BOA | $ 600 | $ (26) | $ (14) | $ (12) | (0,05) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | BRC | 400 | (18) | (12) | (6) | (0,03) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 700 | (31) | (19) | (12) | (0,06) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | HUS | 900 | (40) | (49) | 9 | (0,08) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | BOA | 200 | (5) | (5) | 0 | (0,01) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | BRC | 200 | (5) | (2) | (3) | (0,01) |
| | | | | | $ (143) | $ (114) | $ (29) | (0,28) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 17 | € 15 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (143)** | **(0,28)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 52.896** | **102,65** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 21 | $ 21 | 0,04 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 577 | 577 | 1,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 6 | 6 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 180 | 180 | 0,35 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 173 | 173 | 0,34 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 5 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,01 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 966** | **1,88** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (2.332)** | **(4,53)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 51.530** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.608 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(b) Der Emerging Markets 2018 Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(c) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.800 | $ 51.239 | $ 0 | $ 53.039 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (143) | 0 | (143) |
| **Summen** | **$ 1.800** | **$ 51.096** | **$ 0** | **$ 52.896** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 29.456 | $ 0 | $ 29.456 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (36) | 0 | (36) |
| **Summen** | **$ 0** | **$ 29.420** | **$ 0** | **$ 29.420** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(d) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Class E CHF (Hedged) und Class S CHF (Hedged) die folgenden Devisenkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 206 | CHF 211 | BOA | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 11 | $ 11 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 246 | 249 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 245 | CHF 250 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 4 | $ 4 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 247 | 250 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 245 | CHF 250 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 218 | $ 220 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 247 | CHF 251 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 247 | $ 250 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 02/2016 | $ 249 | CHF 246 | CBK | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | 250 | 247 | JPM | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | 221 | 218 | MSB | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 02/2016 | 250 | 247 | UAG | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | | | | $ 30 | $ (11) | $ 19 | 0,03 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 2.173 | $ 2.388 | BOA | $ 27 | $ 0 | $ 27 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 2.324 | € 2.179 | BOA | 44 | 0 | 44 | 0,09 |
| 01/2016 | 30 | 28 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 94 | $ 102 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 18 | 19 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 108 | € 99 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.913 | 1.805 | GLM | 48 | 0 | 48 | 0,09 |
| 01/2016 | 2.327 | 2.184 | HUS | 45 | 0 | 45 | 0,09 |
| 01/2016 | € 2.173 | $ 2.388 | HUS | 27 | 0 | 27 | 0,05 |
| 01/2016 | 1.934 | 2.113 | JPM | 13 | 0 | 13 | 0,02 |
| 01/2016 | 2.175 | 2.376 | UAG | 13 | 0 | 13 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 2.314 | € 2.177 | UAG | 51 | 0 | 51 | 0,10 |
| 02/2016 | 2.389 | 2.173 | BOA | 0 | (27) | (27) | (0,05) |
| 02/2016 | € 15 | $ 17 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 2.390 | € 2.173 | HUS | 0 | (28) | (28) | (0,05) |
| 02/2016 | 2.115 | 1.934 | JPM | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| 02/2016 | 2.377 | 2.175 | UAG | 0 | (13) | (13) | (0,03) |
| | | | | $ 269 | $ (80) | $ 189 | 0,37 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 5 | £ 3 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 206 | 137 | BPS | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 7 | $ 10 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 164 | 244 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 249 | £ 165 | CBK | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | 249 | 165 | DUB | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 163 | $ 242 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 249 | £ 165 | MSB | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 163 | $ 241 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 144 | 214 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 241 | £ 162 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 242 | 163 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 241 | 163 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 214 | 144 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 6 | $ (28) | $ (22) | (0,04) |

**(e) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (1,750 %) | 25.11.2015 | 23.11.2017 | $ 908 | $ (906) | (1,76) |
| BRC | (0,750 %) | 13.10.2015 | 12.10.2017 | 1.440 | (1.437) | (2,79) |
| | | | | | $ (2.343) | (4,55) |

**(f) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 18 | $ 0 | $ 18 |
| BPS | (9) | 0 | (9) |
| BRC | (23) | 0 | (23) |
| CBK | (6) | 0 | (6) |
| DUB | (1) | 0 | (1) |
| GLM | 48 | 0 | 48 |
| GST | (36) | 0 | (36) |
| JPM | 3 | 0 | 3 |
| MSB | (6) | 0 | (6) |
| UAG | 55 | 0 | 55 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(g) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 102,93 | 97,98 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,28) | (0,12) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Markets 2018 Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,230 % fällig am 12.01.2016 | $ | 4.700 | $ 4.696 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 179.976 | 1.800 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 20.08.2015 | $ | 1.800 | 1.800 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | | 1.700 | 1.700 |
| **Samruk-Energy JSC** | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 1.700 | 1.667 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 1.600 | 1.529 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.300 | 1.300 |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | |
| 9,125 % fällig am 02.07.2018 | | 1.050 | 1.169 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | |
| 5,625 % fällig am 21.06.2018 | | 1.000 | 1.068 |
| **Caixa Economica Federal** | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | | 1.100 | 1.064 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 1.000 | 1.033 |
| **Majapahit Holding BV** | | | |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | | 900 | 1.030 |
| **Kenya Government International Bond** | | | |
| 5,875 % fällig am 24.06.2019 | | 1.000 | 1.000 |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 900 | 982 |
| **Gabon Government International Bond** | | | |
| 8,200 % fällig am 12.12.2017 | | 900 | 941 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,150 % fällig am 10.02.2016 | | 900 | 900 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,230 % fällig am 13.01.2016 | | 900 | 899 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,160 % fällig am 29.01.2016 | | 800 | 800 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | |
| 12,250 % fällig am 15.04.2018 | | 700 | 758 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 700 | 748 |
| **Turkiye Vakiflar Bankasi Tao** | | | |
| 5,000 % fällig am 31.10.2018 | | 700 | 710 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2015 | | 700 | 700 |
| **Turkiye Is Bankasi** | | | |
| 3,750 % fällig am 10.10.2018 | | 700 | 686 |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | | 700 | 636 |
| **China Overseas Finance Cayman III Ltd.** | | | |
| 3,375 % fällig am 29.10.2018 | | 600 | 606 |
| **Turkiye Garanti Bankasi** | | | |
| 4,750 % fällig am 17.10.2019 | | 600 | 602 |
| **African Export-Import Bank** | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2018 | | 600 | 600 |
| **AK Finansal Kiralama** | | | |
| 4,125 % fällig am 17.04.2018 | | 600 | 588 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | | 600 | 588 |
| **SCF Capital Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 27.10.2017 | | 600 | 574 |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | |
| 3,375 % fällig am 02.04.2019 | | 550 | 556 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,065 % fällig am 22.05.2015 | | 500 | 500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 06.01.2016 | | 500 | 500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,155 % fällig am 26.01.2016 | | 500 | 500 |
| **Vedanta Resources PLC** | | | |
| 9,500 % fällig am 18.07.2018 | | 450 | 457 |
| **Cemex SAB de CV** | | | |
| 9,500 % fällig am 15.06.2018 | | 400 | 442 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,230 % fällig am 12.01.2016 | $ | 4.700 | $ 4.697 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 20.08.2015 | | 1.800 | 1.800 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | | 1.700 | 1.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.300 | 1.300 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,160 % fällig am 29.01.2016 | | 700 | 700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2015 | | 700 | 700 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,230 % fällig am 13.01.2016 | | 700 | 700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,065 % fällig am 22.05.2015 | | 500 | 500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 06.01.2016 | | 500 | 500 |
| **China Hongqiao Group Ltd.** | | | |
| 6,875 % fällig am 03.05.2018 | | 500 | 476 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,014 % fällig am 14.05.2015 | | 400 | 400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,088 % fällig am 31.07.2015 | | 400 | 400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2015 | | 400 | 400 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,150 % fällig am 10.02.2016 | | 400 | 400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 07.08.2015 | | 300 | 300 |
| **Pacific Rubiales Energy Corp.** | | | |
| 5,375 % fällig am 26.01.2019 | | 300 | 239 |
| **Afren PLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.04.2019 | | 300 | 117 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 100 | 103 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,085 % fällig am 17.07.2015 | | 100 | 100 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,090 % fällig am 05.08.2015 | | 100 | 100 |

(a) Der Emerging Markets 2018 Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Markets Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ANGOLA** | | | | |
| Angolan Government International Bond | | | | |
| 9,500 % fällig am 12.11.2025 | $ | 4.700 | $ 4.383 | 0,14 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| Republic of Azerbaijan International Bond | | | | |
| 4,750 % fällig am 18.03.2024 | | 9.400 | 8.809 | 0,29 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| Banco do Brasil S.A. | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 33.422 | 25.568 | 0,83 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2020 | | 5.184 | 5.176 | 0,17 |
| Banco do Nordeste do Brasil S.A. | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.05.2019 | | 2.030 | 1.822 | 0,06 |
| Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social | | | | |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 11.770 | 11.623 | 0,38 |
| Banco Santander Brasil S.A. | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | | 100 | 100 | 0,00 |
| BM&FBovespa S.A. - Bolsa de Valores Mercadorias e Futuros | | | | |
| 5,500 % fällig am 16.07.2020 | | 50 | 49 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | | 23.420 | 15.750 | 0,51 |
| 5,625 % fällig am 07.01.2041 | | 4.900 | 3.577 | 0,12 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 40.890 | 30.974 | 1,00 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | BRL | 241 | 46 | 0,00 |
| Caixa Economica Federal | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | $ | 200 | 185 | 0,01 |
| Centrais Eletricas Brasileiras S.A. | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | | 5.600 | 4.438 | 0,14 |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 8.950 | 8.097 | 0,26 |
| Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo | | | | |
| 6,250 % fällig am 16.12.2020 | | 200 | 180 | 0,01 |
| CSN Islands XI Corp. | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.09.2019 (a) | | 2.340 | 1.240 | 0,04 |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 2.740 | 2.048 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 55.000 | 43.312 | 1,41 |
| 6,125 % fällig am 06.10.2016 | | 50 | 50 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 9.400 | 6.768 | 0,22 |
| 6,750 % fällig am 27.01.2041 | | 6.800 | 4.386 | 0,14 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 19.400 | 12.659 | 0,41 |
| 6,875 % fällig am 20.01.2040 | | 7.500 | 4.913 | 0,16 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 47.145 | 41.841 | 1,36 |
| Samarco Mineracao S.A. | | | | |
| 5,750 % fällig am 24.10.2023 | | 7.800 | 2.574 | 0,08 |
| | | | 227.376 | 7,38 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| Gerdau Trade, Inc. | | | | |
| 5,750 % fällig am 30.01.2021 | | 500 | 399 | 0,01 |
| Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 (a) | | 17.425 | 13.069 | 0,42 |
| GTL Trade Finance, Inc. | | | | |
| 5,893 % fällig am 29.04.2024 | | 17.206 | 12.302 | 0,40 |
| 7,250 % fällig am 16.04.2044 | | 600 | 390 | 0,01 |
| Rosneft Finance S.A. | | | | |
| 6,625 % fällig am 20.03.2017 | | 36.352 | 37.301 | 1,21 |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 (a) | | 2.200 | 2.329 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 13.03.2018 | | 22.091 | 23.604 | 0,77 |
| | | | 89.394 | 2,90 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| Banco Continental S.A. via Continental Senior Trustees Cayman Ltd. | | | | |
| 5,500 % fällig am 18.11.2020 (a) | | 7.400 | 7.973 | 0,26 |
| Interoceanica IV Finance Ltd. | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2018 | | 2.855 | 2.684 | 0,08 |
| Interoceanica V Finance Ltd. | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030 | $ | 11.800 | $ 6.490 | 0,21 |
| Lamar Funding Ltd. | | | | |
| 3,958 % fällig am 07.05.2025 | | 11.000 | 9.831 | 0,32 |
| Lima Metro Line 2 Finance Ltd. | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 8.600 | 8.385 | 0,27 |
| Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd. | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 33.098 | 12.246 | 0,40 |
| Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 10.430 | 2.399 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 19.325 | 4.638 | 0,15 |
| Pemex Finance Ltd. | | | | |
| 10,610 % fällig am 15.08.2017 | | 2.516 | 2.704 | 0,09 |
| | | | 57.350 | 1,86 |
| **CHILE** | | | | |
| Banco Santander Chile | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | | 2.800 | 2.795 | 0,09 |
| Celulosa Arauco y Constitucion S.A. | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2024 | | 300 | 298 | 0,01 |
| Chile Government International Bond | | | | |
| 3,625 % fällig am 30.10.2042 | | 2.850 | 2.494 | 0,08 |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile | | | | |
| 3,000 % fällig am 17.07.2022 | | 2.400 | 2.159 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 17.07.2042 | | 9.900 | 7.317 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 13.08.2023 | | 3.104 | 3.019 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 16.09.2025 (a) | | 13.400 | 12.653 | 0,41 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 7.400 | 5.953 | 0,19 |
| 5,625 % fällig am 18.10.2043 | | 1.900 | 1.714 | 0,06 |
| 6,150 % fällig am 24.10.2036 | | 1.000 | 963 | 0,03 |
| Corpbanca S.A. | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.09.2019 | | 10.400 | 10.328 | 0,33 |
| Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A. | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.10.2024 | | 12.500 | 12.043 | 0,39 |
| GNL Quintero S.A. | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 15.200 | 14.436 | 0,47 |
| Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust A | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.11.2027 | | 14.043 | 13.200 | 0,43 |
| | | | 89.372 | 2,90 |
| **CHINA** | | | | |
| CCCI Treasure Ltd. | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2049 | | 7.000 | 6.901 | 0,22 |
| CNOOC Curtis Funding No.1 Pty Ltd. | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 18.300 | 18.946 | 0,62 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd. | | 91.796 | 288 | 0,01 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.05.2042 | $ | 5.200 | 5.350 | 0,17 |
| Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd. | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | | 2.600 | 2.692 | 0,09 |
| | | | 34.177 | 1,11 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| Colombia Government International Bond | | | | |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 6.895 | 6.688 | 0,22 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | | 8.545 | 9.464 | 0,31 |
| 8,125 % fällig am 21.05.2024 | | 1.650 | 1.982 | 0,06 |
| Ecopetrol S.A. | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.06.2026 | | 1.500 | 1.281 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 18.09.2023 | | 9.100 | 8.395 | 0,27 |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 32.300 | 23.094 | 0,75 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 18.600 | 15.670 | 0,51 |
| 7,625 % fällig am 23.07.2019 (a) | | 18.925 | 20.577 | 0,67 |
| | | | 87.151 | 2,83 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| Costa Rica Government International Bond | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2023 | | 2.500 | 2.200 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 30.04.2025 | | 700 | 592 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | | 3.300 | 2.384 | 0,08 |
| Instituto Costarricense de Electricidad | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2043 | $ | 2.200 | $ 1.661 | 0,05 |
| | | | 6.837 | 0,22 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| Dominican Republic Government International Bond | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | | 4.400 | 4.257 | 0,14 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 4.100 | 3.885 | 0,12 |
| | | | 8.142 | 0,26 |
| **EL SALVADOR** | | | | |
| El Salvador Government International Bond | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.01.2025 | | 37.870 | 31.811 | 1,03 |
| 6,375 % fällig am 18.01.2027 | | 900 | 765 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 01.12.2019 | | 950 | 954 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | | 4.900 | 4.826 | 0,16 |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 7.980 | 6.793 | 0,22 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 15.900 | 13.634 | 0,44 |
| 7,750 % fällig am 24.01.2023 | | 3.820 | 3.753 | 0,12 |
| 8,250 % fällig am 10.04.2032 | | 8.980 | 8.419 | 0,27 |
| | | | 70.955 | 2,30 |
| **ÄTHIOPIEN** | | | | |
| Ethiopia International Bond | | | | |
| 6,625 % fällig am 11.12.2024 | | 5.500 | 4.897 | 0,16 |
| **GABUN** | | | | |
| Gabon Government International Bond | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.12.2024 | | 30.841 | 24.612 | 0,80 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| Guatemala Government Bond | | | | |
| 4,875 % fällig am 13.02.2028 | | 5.720 | 5.505 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | | 29.270 | 30.807 | 1,00 |
| 8,125 % fällig am 06.10.2034 | | 1.838 | 2.357 | 0,07 |
| | | | 38.669 | 1,25 |
| **HONGKONG** | | | | |
| CNOOC Finance 2012 Ltd. | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.05.2042 | | 200 | 207 | 0,01 |
| CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd. | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | | 1.900 | 1.859 | 0,06 |
| CNOOC Finance 2015 USA LLC | | | | |
| 3,500 % fällig am 05.05.2025 | | 7.900 | 7.534 | 0,24 |
| CNOOC Nexen Finance 2014 ULC | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | | 4.300 | 4.348 | 0,14 |
| Nexen Energy ULC | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.05.2037 | | 450 | 505 | 0,02 |
| | | | 14.453 | 0,47 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | | | | |
| 4,125 % fällig am 27.04.2017 | | 5.305 | 5.371 | 0,17 |
| Indonesia Government International Bond | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.07.2021 | € | 6.700 | 7.219 | 0,23 |
| 4,625 % fällig am 15.04.2043 | $ | 2.800 | 2.414 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 08.01.2026 | | 4.100 | 4.057 | 0,13 |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037 | | 8.180 | 8.591 | 0,28 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 55.300 | 59.409 | 1,93 |
| 6,875 % fällig am 17.01.2018 | | 9.020 | 9.801 | 0,32 |
| 8,500 % fällig am 12.10.2035 | | 11.090 | 13.838 | 0,45 |
| 11,625 % fällig am 04.03.2019 | | 595 | 749 | 0,02 |
| Majapahit Holding BV | | | | |
| 7,250 % fällig am 28.06.2017 | | 16.500 | 17.573 | 0,57 |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | | 38.070 | 42.686 | 1,39 |
| 7,875 % fällig am 29.06.2037 | | 305 | 331 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | | 14.200 | 15.940 | 0,52 |
| Pelabuhan Indonesia II PT | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 6.600 | 5.880 | 0,19 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 3.000 | 2.378 | 0,08 |
| Pertamina Persero PT | | | | |
| 4,300 % fällig am 20.05.2023 | | 10.900 | 9.936 | 0,32 |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 15.400 | 12.672 | 0,41 |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | | 20.000 | 17.474 | 0,57 |
| | | | 236.319 | 7,67 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **IRLAND** | | | | |
| Metalloinvest Finance Ltd. | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.04.2020 | $ | 9.000 | $ 8.677 | 0,28 |
| Novatek OAO via Novatek Finance Ltd. | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 28.100 | 24.974 | 0,81 |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | | 14.000 | 14.070 | 0,46 |
| OJSC Novolipetsk Steel via Steel Funding Ltd. | | | | |
| 4,450 % fällig am 19.02.2018 | | 12.100 | 11.987 | 0,39 |
| | | AKTIEN | | |
| PIMCO China Bond Fund (b) | | 819.640 | 9.082 | 0,29 |
| | | PARI (000S) | | |
| Russian Railways via RZD Capital PLC | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 5.400 | 7.541 | 0,24 |
| Vnesheconombank Via VEB Finance PLC | | | | |
| 5,375 % fällig am 13.02.2017 | $ | 265 | 267 | 0,01 |
| 5,450 % fällig am 22.11.2017 (a) | | 7.800 | 7.817 | 0,25 |
| 6,025 % fällig am 05.07.2022 | | 17.115 | 16.249 | 0,53 |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | | 10.840 | 11.002 | 0,36 |
| | | | 111.666 | 3,62 |
| **ISRAEL** | | | | |
| Delek & Avner Tamar Bond Ltd. | | | | |
| 5,082 % fällig am 30.12.2023 | | 15.000 | 15.131 | 0,49 |
| 5,412 % fällig am 30.12.2025 | | 14.100 | 14.224 | 0,46 |
| Israel Electric Corp. Ltd. | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.11.2024 | | 12.200 | 12.471 | 0,41 |
| | | | 41.826 | 1,36 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| Ivory Coast Government International Bond | | | | |
| 5,375 % fällig am 23.07.2024 | | 6.200 | 5.527 | 0,18 |
| **JAMAIKA** | | | | |
| Jamaica Government International Bond | | | | |
| 6,750 % fällig am 28.04.2028 | | 3.400 | 3.383 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 28.07.2045 | | 3.300 | 3.218 | 0,10 |
| | | | 6.601 | 0,21 |
| **JAPAN** | | | | |
| Japan Treasury Bills | | | | |
| (0,033 %) fällig am 22.02.2016 | JPY | 2.930.000 | 24.358 | 0,79 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| KazAgro National Management Holding JSC | | | | |
| 3,255 % fällig am 22.05.2019 | € | 16.400 | 16.765 | 0,54 |
| Kazakhstan Government International Bond | | | | |
| 4,875 % fällig am 14.10.2044 | $ | 11.700 | 9.810 | 0,32 |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | | 14.400 | 14.242 | 0,46 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 8.900 | 8.785 | 0,29 |
| KazMunayGas National Co. JSC | | | | |
| 6,375 % fällig am 09.04.2021 | | 17.938 | 18.534 | 0,60 |
| 7,000 % fällig am 05.05.2020 | | 22.871 | 24.282 | 0,79 |
| 9,125 % fällig am 02.07.2018 | | 32.006 | 35.317 | 1,15 |
| Samruk-Energy JSC | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 26.520 | 25.990 | 0,84 |
| | | | 153.725 | 4,99 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.03.2025 | | 2.500 | 2.492 | 0,08 |
| Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 10.700 | 9.503 | 0,31 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 5.800 | 5.488 | 0,18 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 3.800 | 5.384 | 0,17 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ | 8.320 | 8.318 | 0,27 |
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | | 5.740 | 5.734 | 0,19 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 1.800 | 2.026 | 0,07 |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 23.300 | 26.086 | 0,85 |
| Millicom International Cellular S.A. | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.03.2025 | | 2.000 | 1.710 | 0,05 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | | 42.155 | 42.475 | 1,38 |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | $ | 1.350 | $ 1.375 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 26.02.2024 | | 7.200 | 6.354 | 0,21 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 12.565 | 12.652 | 0,41 |
| | | | 129.597 | 4,21 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| Petronas Capital Ltd. | | | | |
| 4,500 % fällig am 18.03.2045 | | 1.800 | 1.713 | 0,06 |
| | | AKTIEN | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V. | | 39.443 | 0 | 0,00 |
| | | PARI (000S) | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| America Movil SAB de C.V. | | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 88.000 | 4.856 | 0,16 |
| Banco Inbursa S.A. Institucion de Banca Multiple | | | | |
| 4,125 % fällig am 06.06.2024 | $ | 7.000 | 6.597 | 0,21 |
| Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 7.080 | 7.089 | 0,23 |
| BBVA Bancomer S.A. | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 18.235 | 19.420 | 0,63 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 9.640 | 10.628 | 0,35 |
| Cemex SAB de C.V. | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.01.2022 | € | 5.200 | 5.282 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 05.05.2025 (a) | $ | 9.700 | 8.318 | 0,27 |
| Comision Federal de Electricidad | | | | |
| 6,125 % fällig am 16.06.2045 | | 2.200 | 2.029 | 0,07 |
| Corporation GEO SAB de C.V. (c) | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 | | 13.920 | 296 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 | | 1.000 | 21 | 0,00 |
| Grupo Televisa SAB | | | | |
| 5,000 % fällig am 13.05.2045 | | 4.400 | 3.805 | 0,12 |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 9.300 | 7.445 | 0,24 |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | $ | 1.300 | 1.137 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 24.01.2022 | | 4.000 | 3.860 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | | 1.600 | 1.618 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2044 | | 62.010 | 46.963 | 1,52 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2018 | | 13.230 | 13.805 | 0,45 |
| 6,000 % fällig am 05.03.2020 | | 7.700 | 8.020 | 0,26 |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045 | | 7.500 | 6.385 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 112.700 | 97.993 | 3,18 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 36.080 | 32.427 | 1,05 |
| Urbi Desarrollos Urbanos SAB de C.V. | | | | |
| 9,500 % fällig am 21.01.2020 (c) | | 2.750 | 10 | 0,00 |
| | | | 288.004 | 9,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 3,600 % fällig am 30.01.2025 | | 108 | 106 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 12.370 | 11.256 | 0,37 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | $ | 18.231 | 16.203 | 0,53 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 21.01.2045 | | 19.490 | 20.050 | 0,65 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 | | 24.800 | 23.250 | 0,75 |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 12.888 | 14.161 | 0,46 |
| | | | 85.035 | 2,76 |
| Summe Mexiko | | | 373.039 | 12,11 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| Mongolia Government International Bond | | | | |
| 4,125 % fällig am 05.01.2018 | | 13.200 | 12.128 | 0,39 |
| 5,125 % fällig am 05.12.2022 | | 9.165 | 7.324 | 0,24 |
| | | | 19.452 | 0,63 |
| **MAROKKO** | | | | |
| Morocco Government International Bond | | | | |
| 3,500 % fällig am 19.06.2024 | € | 10.400 | 11.421 | 0,37 |
| **NAMIBIA** | | | | |
| Namibia International Bond | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | $ | 2.300 | $ 2.147 | 0,07 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| CIMPOR Financial Operations BV | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | | 20.200 | 13.635 | 0,44 |
| Kazakhstan Temir Zholy Finance BV | | | | |
| 6,375 % fällig am 06.10.2020 | | 20.925 | 20.678 | 0,67 |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 7.260 | 6.398 | 0,21 |
| | | | 40.711 | 1,32 |
| **PANAMA** | | | | |
| ENA Norte Trust | | | | |
| 4,950 % fällig am 25.04.2023 | | 4.345 | 4.450 | 0,14 |
| Panama Government International Bond | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.09.2024 | | 12.300 | 12.361 | 0,40 |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053 | | 13.500 | 11.559 | 0,38 |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 8.000 | 9.540 | 0,31 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 300 | 392 | 0,01 |
| 9,375 % fällig am 01.04.2029 | | 10.833 | 15.654 | 0,51 |
| | | | 53.956 | 1,75 |
| **PARAGUAY** | | | | |
| Republic of Paraguay International Bond | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.01.2023 | | 3.000 | 2.925 | 0,09 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 7.000 | 6.720 | 0,22 |
| | | | 9.645 | 0,31 |
| **PERU** | | | | |
| BBVA Banco Continental S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.08.2022 | | 2.000 | 2.050 | 0,07 |
| Corporation Financiera de Desarrollo S.A. | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.02.2022 | | 5.000 | 5.100 | 0,16 |
| Fondo MIVIVIENDA S.A. | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 6.600 | 6.191 | 0,20 |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2026 | € | 5.000 | 5.404 | 0,17 |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | $ | 5.043 | 5.850 | 0,19 |
| 8,750 % fällig am 21.11.2033 | | 4.321 | 6.103 | 0,20 |
| Union Andina de Cementos SAA | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2021 | | 4.400 | 4.257 | 0,14 |
| | | | 34.955 | 1,13 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| Energy Development Corp. | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.01.2021 (a) | | 1.300 | 1.432 | 0,05 |
| Power Sector Assets & Liabilities Management Corp. | | | | |
| 7,390 % fällig am 02.12.2024 | | 3.200 | 4.140 | 0,13 |
| | | | 5.572 | 0,18 |
| **KATAR** | | | | |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | | 26 | 27 | 0,00 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| Romania Government International Bond | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.10.2025 | € | 1.400 | 1.544 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 22.01.2044 | $ | 200 | 235 | 0,01 |
| | | | 1.779 | 0,06 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| Russia Government International Bond | | | | |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | | 6.200 | 5.894 | 0,19 |
| SCF Capital Ltd. | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.10.2017 | | 32.905 | 32.699 | 1,06 |
| Sibur Securities Ltd. | | | | |
| 3,914 % fällig am 31.01.2018 | | 15.900 | 15.483 | 0,50 |
| VimpelCom Holdings BV | | | | |
| 5,200 % fällig am 13.02.2019 | | 400 | 394 | 0,01 |
| 7,504 % fällig am 01.03.2022 | | 200 | 201 | 0,01 |
| | | | 54.671 | 1,77 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SENEGAL** | | | | |
| Senegal Government International Bond | | | | |
| 8,750 % fällig am 13.05.2021 | $ | 10.600 | $ 11.157 | 0,36 |
| **SERBIEN** | | | | |
| Republic of Serbia | | | | |
| 5,875 % fällig am 03.12.2018 | | 2.100 | 2.215 | 0,07 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 7.300 | 8.071 | 0,26 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2020 | | 10.560 | 9.330 | 0,30 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2040 | | 200 | 134 | 0,01 |
| Eskom Holdings SOC Ltd. | | | | |
| 5,750 % fällig am 26.01.2021 | | 16.300 | 14.242 | 0,46 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | | 27.700 | 24.168 | 0,79 |
| Myriad International Holdings BV | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.07.2025 | | 9.000 | 8.696 | 0,28 |
| South Africa Government International Bond | | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | | 15.700 | 14.208 | 0,46 |
| Transnet SOC Ltd. | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.07.2022 | | 2.500 | 2.219 | 0,07 |
| | | | 72.997 | 2,37 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 200 | 235 | 0,01 |
| Autonomous Community of Valencia | | | | |
| 2,289 % fällig am 03.09.2017 | | 250 | 274 | 0,01 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 54.800 | 64.994 | 2,11 |
| | | | 65.503 | 2,13 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| National Savings Bank | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | $ | 9.000 | 8.415 | 0,28 |
| Sri Lanka Government International Bond | | | | |
| 5,125 % fällig am 11.04.2019 | | 7.800 | 7.447 | 0,24 |
| 6,250 % fällig am 04.10.2020 | | 4.800 | 4.651 | 0,15 |
| 6,250 % fällig am 27.07.2021 | | 6.511 | 6.219 | 0,20 |
| | | | 26.732 | 0,87 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| Africa Finance Corp. | | | | |
| 4,375 % fällig am 29.04.2020 | | 4.800 | 4.830 | 0,16 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB | | | | |
| 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 4.000 | 4.181 | 0,14 |
| **TANSANIA** | | | | |
| Tanzania Government International Bond | | | | |
| 6,538 % fällig am 09.03.2020 | | 7.500 | 7.106 | 0,23 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | | |
| Petroleum Co. of Trinidad & Tobago Ltd. | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.05.2022 | | 13.655 | 12.768 | 0,41 |
| 9,750 % fällig am 14.08.2019 | | 2.500 | 2.612 | 0,09 |
| | | | 15.380 | 0,50 |
| **TUNESIEN** | | | | |
| Banque Centrale de Tunisie International Bond | | | | |
| 3,280 % fällig am 09.08.2027 | JPY | 100.000 | 680 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2025 | $ | 1.900 | 1.654 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 19.09.2027 | | 3.200 | 3.346 | 0,11 |
| | | | 5.680 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TÜRKEI** | | | | |
| Arcelik | | | | |
| 5,000 % fällig am 03.04.2023 (a) | $ | 6.700 | $ 6.129 | 0,20 |
| Export Credit Bank of Turkey | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2019 | | 19.400 | 20.068 | 0,65 |
| Turkey Government International Bond | | | | |
| 4,125 % fällig am 11.04.2023 | € | 300 | 344 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041 | $ | 24.820 | 25.437 | 0,83 |
| 6,250 % fällig am 26.09.2022 | | 6.400 | 6.969 | 0,23 |
| 6,750 % fällig am 30.05.2040 | | 1.700 | 1.895 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 28.370 | 31.834 | 1,03 |
| 7,000 % fällig am 11.03.2019 | | 300 | 329 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 05.06.2020 | | 800 | 892 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 05.03.2038 | | 4.800 | 5.635 | 0,18 |
| 7,500 % fällig am 07.11.2019 | | 2.208 | 2.482 | 0,08 |
| 8,000 % fällig am 14.02.2034 | | 1.415 | 1.772 | 0,06 |
| Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2027 | | 5.863 | 5.636 | 0,18 |
| | | | 109.422 | 3,55 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| DP World Ltd. | | | | |
| 3,250 % fällig am 18.05.2020 | | 6.300 | 6.269 | 0,20 |
| Dubai Government International Bond | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.01.2043 | | 3.200 | 2.716 | 0,09 |
| | | | 8.985 | 0,29 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| Afren PLC | | | | |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 (c) | | 9.075 | 183 | 0,01 |
| 15,000 % fällig am 25.04.2016 (h) | | 12.000 | 4.920 | 0,16 |
| Barclays PLC | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 11.400 | 16.836 | 0,55 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 900 | 939 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 400 | 424 | 0,01 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 4.000 | 6.004 | 0,19 |
| | | | 29.306 | 0,95 |
| **USA** | | | | |
| Banc of America Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,451 % fällig am 15.01.2049 | $ | 1.046 | 1.074 | 0,03 |
| 5,558 % fällig am 10.06.2049 | | 2.043 | 2.102 | 0,07 |
| 5,742 % fällig am 10.02.2051 | | 2.611 | 2.719 | 0,09 |
| Banc of America Mortgage Trust | | | | |
| 2,635 % fällig am 25.02.2036 (c) | | 28 | 25 | 0,00 |
| Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust | | | | |
| 2,735 % fällig am 25.01.2035 | | 32 | 31 | 0,00 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (c) | | 502 | 453 | 0,01 |
| California Resources Corp. | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 1.356 | 490 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 1.631 | 522 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 8.010 | 4.235 | 0,14 |
| CCO Safari II LLC | | | | |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 1.200 | 1.215 | 0,04 |
| 6,484 % fällig am 23.10.2045 | | 2.700 | 2.711 | 0,09 |
| 6,834 % fällig am 23.10.2055 | | 1.000 | 989 | 0,03 |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | |
| 2,905 % fällig am 25.09.2037 (c) | | 899 | 818 | 0,03 |
| Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,796 % fällig am 10.12.2049 | | 930 | 965 | 0,03 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust | | | | |
| 2,606 % fällig am 20.05.2036 (c) | | 290 | 262 | 0,01 |
| Fannie Mae | | | | |
| 2,493 % fällig am 01.12.2035 | | 41 | 43 | 0,00 |
| 2,505 % fällig am 01.01.2036 | | 38 | 41 | 0,00 |
| 2,505 % fällig am 01.03.2036 | | 34 | 36 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2038 | | 7 | 8 | 0,00 |
| GSR Mortgage Loan Trust | | | | |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (c) | | 160 | 149 | 0,00 |
| JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust | | | | |
| 5,440 % fällig am 12.06.2047 | | 379 | 388 | 0,01 |
| LB-UBS Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,424 % fällig am 15.02.2040 | | 1.611 | 1.649 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,700 % fällig am 12.09.2049 | $ | 680 | $ 708 | 0,02 |
| Morgan Stanley Capital I Trust | | | | |
| 5,917 % fällig am 11.06.2049 | | 167 | 174 | 0,01 |
| Morgan Stanley Mortgage Loan Trust | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.02.2037 | | 364 | 199 | 0,01 |
| Rio Oil Finance Trust Series 2014-1 | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 35.150 | 26.055 | 0,85 |
| Rio Oil Finance Trust Series 2014-3 | | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 26.350 | 19.400 | 0,63 |
| SLM Private Credit Student Loan Trust | | | | |
| 0,692 % fällig am 15.03.2024 | | 1.094 | 1.079 | 0,03 |
| Southern Copper Corp. | | | | |
| 5,250 % fällig am 08.11.2042 | | 1.300 | 944 | 0,03 |
| Structured Asset Investment Loan Trust | | | | |
| 1,127 % fällig am 25.02.2035 | | 1.198 | 1.200 | 0,04 |
| Terraform Global Operating LLC | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | | 4.800 | 3.852 | 0,12 |
| US Treasury Bills | | | | |
| 0,190 % fällig am 14.01.2016 (d) | | 1.435 | 1.435 | 0,05 |
| US Treasury Bonds | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 41.400 | 41.283 | 1,34 |
| US Treasury Notes | | | | |
| 0,428 % fällig am 31.10.2017 (d) | | 2.399 | 2.397 | 0,08 |
| Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,572 % fällig am 15.10.2048 | | 770 | 782 | 0,03 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| 2,402 % fällig am 25.02.2037 (c) | | 578 | 513 | 0,02 |
| Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.07.2037 (c) | | 94 | 82 | 0,00 |
| | | | 121.028 | 3,93 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| RBC Capital Markets LLC | | | | |
| 0,540 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022 bewertet mit $44.460. Die Rückkauferlöse betragen $43.503.) | | 43.500 | 43.500 | 1,41 |
| | | | 164.528 | 5,34 |
| **URUGUAY** | | | | |
| Uruguay Government International Bond | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.10.2027 | | 8.231 | 8.128 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 14.08.2024 | | 2.507 | 2.551 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 14.09.2018 (e) | UYU | 50.587 | 1.692 | 0,06 |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | $ | 7.200 | 6.228 | 0,20 |
| 6,875 % fällig am 28.09.2025 | | 2.879 | 3.368 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 21.03.2036 | | 3.200 | 3.968 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 15.01.2033 | | 11.550 | 14.438 | 0,47 |
| | | | 40.373 | 1,31 |
| **VENEZUELA** | | | | |
| Petroleos de Venezuela S.A. | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.04.2017 | | 45.573 | 23.010 | 0,75 |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 | | 77.440 | 28.266 | 0,92 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 | | 17.645 | 6.449 | 0,21 |
| 8,500 % fällig am 02.11.2017 | | 8.483 | 4.539 | 0,15 |
| Venezuela Government International Bond | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 | | 5.120 | 1.933 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 | | 24.650 | 9.305 | 0,30 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 | | 30.554 | 11.458 | 0,37 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 | | 8.880 | 3.574 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 | | 19.827 | 7.633 | 0,25 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 | | 13.717 | 5.521 | 0,18 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 | | 19.500 | 7.702 | 0,25 |
| 9,375 % fällig am 13.01.2034 | | 3.607 | 1.434 | 0,05 |
| | | | 110.824 | 3,60 |
| **SAMBIA** | | | | |
| Zambia Government International Bond | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.09.2022 | | 5.300 | 3.857 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (b)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 29.985.287 | $ 299.913 | 9,73 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.076.344** | **99,83** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 81.536 | $ 386 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | $ 37.000 | $ 413 | 0,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 799** | **0,03** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 11.000 | $ 495 | $ 584 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,000 | 28.03.2016 | 13.200 | 581 | 701 | 0,02 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BPS | JPY 119,000 | 13.01.2016 | 135.600 | 749 | 268 | 0,01 |
| | | | | | $ 1.825 | $ 1.553 | 0,05 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,130 | 09.02.2016 | € 29.400 | $ (201) | $ (58) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 11.000 | (235) | (284) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,300 | 28.03.2016 | 13.200 | (273) | (341) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 11.000 | (225) | (169) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,800 | 28.03.2016 | 13.200 | (283) | (203) | (0,01) |
| | | | | | $ (1.217) | $ (1.055) | (0,03) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | BRC | $ 1.740 | $ 178 | $ 170 | $ 8 | 0,01 |
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | CBK | 9.860 | 1.009 | 952 | 57 | 0,03 |
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | GST | 6.200 | 635 | 592 | 43 | 0,02 |
| | | | | | $ 1.822 | $ 1.714 | $ 108 | 0,06 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Banque Centrale de Tunisie International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | $ 10.000 | $ (25) | $ (369) | $ 344 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2017 | BOA | 10.000 | (284) | (240) | (44) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 11.700 | (1.129) | (536) | (593) | (0,04) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 1.100 | (160) | (67) | (93) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | BOA | 400 | (76) | (16) | (60) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2025 | BOA | 500 | (147) | (101) | (46) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BPS | 800 | (85) | (30) | (55) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 1.500 | (16) | (19) | 3 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2017 | BRC | 13.300 | (378) | (320) | (58) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 800 | (85) | (32) | (53) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 6.900 | (1.139) | (1.017) | (122) | (0,04) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 5.900 | 0 | (13) | 13 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 1.400 | (15) | (18) | 3 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2017 | DUB | 3.400 | (97) | (102) | 5 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 900 | (87) | (41) | (46) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | DUB | 5.000 | (826) | (643) | (183) | (0,03) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | FBF | 400 | (35) | (19) | (16) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 3.000 | (467) | (212) | (255) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 12.100 | 1 | (3) | 4 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 5.000 | (54) | (65) | 11 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2017 | GST | 6.500 | (185) | (174) | (11) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2017 | GST | 470 | (17) | (12) | (5) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 9.700 | (840) | (325) | (515) | (0,03) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 1.400 | (149) | (62) | (87) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 2.400 | (350) | (151) | (199) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 2.000 | (330) | (278) | (52) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 2.300 | (12) | 1 | (13) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 11.800 | (1.949) | (1.614) | (335) | (0,06) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | JPM | 1.500 | (8) | 0 | (8) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | JPM | 1.400 | (15) | (16) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2017 | JPM | 7.500 | (213) | (188) | (25) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 1.300 | (202) | (99) | (103) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 5.500 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 2,100 % | 20.08.2016 | MYC | 4.500 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 4.100 | 4 | 45 | (41) | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 3.200 | 3 | 35 | (32) | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 4.300 | (40) | 12 | (52) | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 5.700 | 5 | 57 | (52) | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 3.300 | 23 | (157) | 180 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 6.800 | 46 | (323) | 369 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 9.700 | 97 | 91 | 6 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | FBF | 3.900 | 27 | (193) | 220 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 11.100 | (272) | (91) | (181) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 6.300 | (207) | (37) | (170) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 7.100 | (408) | (385) | (23) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 8.000 | (263) | (18) | (245) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 1.500 | (86) | (85) | (1) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 7.600 | (187) | (64) | (123) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 19.100 | (628) | 105 | (733) | (0,02) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 2.000 | (57) | (18) | (39) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | DUB | 3.600 | (207) | (200) | (7) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 1.300 | (75) | (70) | (5) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 12.800 | 1 | 3 | (2) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 16.500 | (542) | 89 | (631) | (0,02) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | HUS | 5.000 | (7) | (3) | (4) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 5.000 | (287) | (283) | (4) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 3.500 | (86) | (26) | (60) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 11.000 | (315) | (102) | (213) | (0,01) |
| Dominican Republic Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | 3.200 | (6) | (111) | 105 | 0,00 |
| Egypt Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | FBF | 3.600 | (37) | (376) | 339 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 1.900 | 9 | (38) | 47 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | FBF | 9.100 | 43 | (223) | 266 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 600 | 3 | (16) | 19 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 5.800 | (415) | (286) | (129) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BOA | 20.800 | (672) | (532) | (140) | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 6.800 | (359) | (421) | 62 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 12.000 | (634) | (462) | (172) | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | BRC | 7.800 | (981) | (1.077) | 96 | (0,03) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | CBK | 3.800 | (478) | (519) | 41 | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | DUB | 9.700 | (313) | (232) | (81) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2021 | FBF | 4.100 | (292) | (263) | (29) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | GST | 10.100 | (1.270) | (1.381) | 111 | (0,04) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 10.000 | (232) | (217) | (15) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 12.100 | (639) | (755) | 116 | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2021 | MYC | 7.500 | (490) | (543) | 53 | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2021 | UAG | 1.200 | (86) | (80) | (6) | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 2.400 | (12) | (19) | 7 | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 6.100 | (31) | (52) | 21 | 0,00 |
| Malaysia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | DUB | 4.100 | (92) | (35) | (57) | 0,00 |
| Malaysia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 8.500 | (279) | (102) | (177) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2021 | HUS | 9.200 | (328) | (423) | 95 | (0,01) |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Morocco Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | $ 10.000 | $ 4 | $ (305) | $ 309 | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 7.500 | (91) | (42) | (49) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 3.200 | (48) | 12 | (60) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 7.500 | (112) | 48 | (160) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 800 | (10) | (5) | (5) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 200 | (3) | 1 | (4) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | FBF | 2.900 | (27) | (21) | (6) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 7.300 | (68) | (50) | (18) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 8.000 | (97) | (51) | (46) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 17.500 | (261) | 111 | (372) | (0,01) |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | HUS | 4.700 | (44) | (28) | (16) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 5.000 | (46) | (36) | (10) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 1.400 | (21) | 7 | (28) | 0,00 |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 9.000 | (126) | (136) | 10 | 0,00 |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 4.700 | (169) | (198) | 29 | (0,01) |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | FBF | 1.300 | (18) | (19) | 1 | 0,00 |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 9.600 | (482) | (187) | (295) | (0,02) |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 500 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 500 | 1 | (4) | 5 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | FBF | 5.200 | 9 | (3) | 12 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | 10.800 | 37 | 1 | 36 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | UAG | 2.000 | 7 | (3) | 10 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 9.300 | (37) | (124) | 87 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 7.800 | (328) | (254) | (74) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 800 | (38) | (66) | 28 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 6.100 | (24) | (132) | 108 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 26.000 | (2.385) | (3.253) | 868 | (0,08) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 200 | (10) | (17) | 7 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | CBK | 3.400 | (245) | (543) | 298 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 25.000 | (21) | (607) | 586 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 2.400 | (9) | (50) | 41 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2018 | GST | 12.900 | (344) | (134) | (210) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 4.700 | (174) | (213) | 39 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 15.700 | (1.339) | (1.625) | 286 | (0,04) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 400 | (19) | (33) | 14 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 7.000 | (6) | (21) | 15 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 6.600 | (278) | (218) | (60) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 25.000 | (2.133) | (2.850) | 717 | (0,07) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 18.400 | (15) | (33) | 18 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | UAG | 4.600 | (4) | (89) | 85 | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 4.500 | (430) | (248) | (182) | (0,01) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 5.500 | (526) | (331) | (195) | (0,02) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 2.100 | (130) | (67) | (63) | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | DUB | 400 | (1) | (4) | 3 | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2023 | HUS | 7.400 | (1.148) | (766) | (382) | (0,04) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 2.400 | (87) | (136) | 49 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 4.200 | (6) | (35) | 29 | 0,00 |
| | | | | | $ (31.680) | $ (29.321) | $ (2.359) | (1,03) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | BPS | BRL 77.900 | $ (136) | $ (7) | $ (129) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | CBK | 171.000 | (299) | (25) | (274) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | HUS | 2.200 | (2) | (1) | (1) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,420 % | 02.01.2017 | BOA | 236.000 | (7.153) | 888 | (8.041) | (0,23) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,590 % | 02.01.2017 | UAG | 25.000 | (753) | (10) | (743) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,630 % | 02.01.2017 | MYC | 50.000 | (1.489) | 4 | (1.493) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,860 % | 02.01.2017 | BOA | 4.800 | (120) | (3) | (117) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 10,910 % | 02.01.2017 | DUB | 71.400 | 873 | 61 | 812 | 0,03 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 10,910 % | 02.01.2017 | UAG | 151.000 | 1.847 | 631 | 1.216 | 0,06 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | BPS | 88.500 | 521 | (106) | 627 | 0,02 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | DUB | 161.500 | 950 | (206) | 1.156 | 0,03 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2017 | JPM | 333.600 | (1.510) | 0 | (1.510) | (0,05) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,820 % | 02.01.2017 | DUB | 366.000 | 1.549 | 0 | 1.549 | 0,05 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | BPS | 63.100 | (251) | 142 | (393) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | BPS | BRL 202.500 | $ (118) | $ 18 | $ (136) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | DUB | 102.000 | (59) | 5 | (64) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | HUS | 77.450 | 1.254 | 1.007 | 247 | 0,04 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,860 % | 02.01.2018 | BPS | 81.400 | (1.126) | (955) | (171) | (0,04) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,000 % | 02.01.2018 | DUB | 94.100 | 1.247 | (10) | 1.257 | 0,04 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,000 % | 02.01.2018 | JPM | 218.700 | 2.899 | 0 | 2.899 | 0,09 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,375 % | 02.01.2018 | HUS | 5.400 | (62) | 0 | (62) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | GLM | 135.000 | (1.339) | (36) | (1.303) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,960 % | 02.01.2019 | JPM | 54.000 | (155) | (46) | (109) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | BPS | 38.500 | (1.141) | (18) | (1.123) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 04.01.2021 | BOA | 85.000 | (2.511) | 0 | (2.511) | (0,08) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 41.800 | (1.165) | (67) | (1.098) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BPS | 4.700 | (131) | (3) | (128) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 40.000 | (1.115) | (61) | (1.054) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 1.000 | (24) | 3 | (27) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | BPS | 7.910 | 166 | 152 | 14 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,315 % | 04.01.2021 | HUS | 4.400 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 147.300 | 275 | 8 | 267 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,285 % | 02.01.2025 | DUB | 47.900 | (1.670) | 0 | (1.670) | (0,05) |
| | | | | | | $ (10.659) | $ 1.365 | $ (12.024) | (0,35) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 1 | $ | 1 | RBC | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 112.959 | BRL | 441.082 | BOA | 0 | (1.469) | (1.469) | (0,05) |
| 01/2016 | BRL | 441.082 | $ | 110.841 | BOA | 173 | (822) | (649) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 33.691 | BRL | 131.556 | BPS | 0 | (438) | (438) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 131.556 | $ | 43.886 | BPS | 10.633 | 0 | 10.633 | 0,35 |
| 01/2016 | | 217.659 | | 55.741 | CBK | 725 | 0 | 725 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 55.677 | BRL | 217.659 | CBK | 0 | (661) | (661) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 550.726 | $ | 141.069 | DUB | 1.865 | 0 | 1.865 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 145.810 | BRL | 550.726 | DUB | 0 | (6.606) | (6.606) | (0,21) |
| 01/2016 | BRL | 20.956 | $ | 5.367 | FBF | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.394 | BRL | 20.956 | FBF | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 170.878 | $ | 58.600 | GLM | 15.408 | 0 | 15.408 | 0,50 |
| 01/2016 | $ | 43.822 | BRL | 170.878 | GLM | 0 | (630) | (630) | (0,02) |
| 01/2016 | | 8.626 | | 33.681 | JPM | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 33.681 | $ | 8.528 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 133 | € | 122 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 89.715 | $ | 95.653 | BOA | 0 | (1.805) | (1.805) | (0,06) |
| 01/2016 | $ | 4 | € | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 156 | | 143 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 19.890 | | 18.188 | JPM | 0 | (132) | (132) | 0,00 |
| 01/2016 | | 198 | | 181 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 163.434 | | 149.624 | UAG | 0 | (898) | (898) | (0,03) |
| 01/2016 | € | 78.097 | $ | 82.995 | UAG | 0 | (1.842) | (1.842) | (0,06) |
| 01/2016 | £ | 2 | | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.417 | | 18.720 | MSB | 419 | 0 | 419 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2 | £ | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.372 | | 12.417 | UAG | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 459.600 | $ | 3.763 | GLM | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.796 | JPY | 459.600 | MSB | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 6.825.501 | $ | 5.952 | GLM | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 1.094 | | 259 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | SGD | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 0 | | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 101.347 | BRL | 408.319 | BOA | 813 | 0 | 813 | 0,03 |
| 02/2016 | BRL | 2.611 | $ | 710 | BRC | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.921 | | 1.067 | CBK | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| 02/2016 | | 178.877 | | 48.726 | MSB | 3.971 | 0 | 3.971 | 0,13 |
| 02/2016 | $ | 511 | CHF | 511 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 149.624 | $ | 163.549 | UAG | 898 | 0 | 898 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 1.259 | £ | 830 | BOA | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 11.518 | $ | 17.398 | HUS | 420 | 0 | 420 | 0,01 |
| 02/2016 | | 12.417 | | 18.373 | UAG | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 678 | INR | 45.834 | FBF | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 1.390.000 | $ | 11.337 | BPS | 0 | (230) | (230) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.540.000 | | 12.560 | CBK | 0 | (255) | (255) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 2.704 | JPY | 332.700 | JPM | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 459.600 | $ | 3.798 | MSB | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 14.697 | | 10.439 | SCX | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 402.032 | | 11.199 | BOA | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 686.191 | | 21.143 | BPS | 350 | 0 | 350 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 36.655 | MXN | 628.538 | GLM | 0 | (445) | (445) | (0,01) |
| 05/2016 | | 143 | ZAR | 2.144 | BOA | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 259.124 | $ | 65.543 | BOA | 3.894 | 0 | 3.894 | 0,13 |
| 07/2016 | | 81.081 | | 20.567 | BPS | 1.277 | 0 | 1.277 | 0,04 |
| 10/2016 | $ | 13.281 | BRL | 57.772 | BPS | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 92.682 | $ | 25.495 | DUB | 4.127 | 0 | 4.127 | 0,13 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 10/2016 | BRL | 57.686 | $ | 13.281 | GLM | $ 0 | $ (19) | $ (19) | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 93.671 | | 14.395 | HUS | 548 | 0 | 548 | 0,02 |
| | | | | | | $ 46.247 | $ (16.661) | $ 29.586 | 0,96 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (10.433)** | **(0,34)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac TBA** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.01.2046 (g) | $ | (1.000) | $ (1.092) | (0,04) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (1.092)** | **(0,04)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 3.065.618** | **99,48** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 33 | $ 24 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 61 | 90 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 172 | 172 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 82 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4.759 | 4.759 | 0,15 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 2 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 23 | 23 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 52 | 52 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.484 | 1.484 | 0,05 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 458 | 458 | 0,02 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 5 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 6 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.430 | 1.430 | 0,05 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 19 | 14 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 66 | 47 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 89 | 97 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 19 | 28 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 35 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 34 | 34 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 8.718** | **0,28** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 7.167** | **0,24** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 3.081.503** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 37.574 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(c) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(d) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.832 und Barmittel in Höhe von USD 12.857 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(f) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 27.471 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(g) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 15,000 % | 25.04.2016 | 30.04.2015 | $ 11.584 | $ 4.920 | 0,16 |

**(i) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 308.995 | $ 2.753.255 | $ 14.094 | $ 3.076.344 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (9.634) | 0 | (9.634) |
| Leerverkäufe | 0 | (1.092) | 0 | (1.092) |
| **Summen** | **$ 308.995** | **$ 2.742.529** | **$ 14.094** | **$ 3.065.618** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 224.586 | $ 4.441.096 | $ 11.205 | $ 4.676.887 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (45.250) | 0 | (45.250) |
| Leerverkäufe | 0 | (1.104) | 0 | (1.104) |
| **Summen** | **$ 224.586** | **$ 4.394.742** | **$ 11.205** | **$ 4.630.533** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class M Retail AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 598 | $ | 429 | AZD | $ 0 | $ (6) | $ (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 45 | | 33 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 15 | AUD | 21 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 40 | $ | 29 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 607 | | 441 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7 | AUD | 9 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 445 | | 616 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 598 | $ | 435 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 443 | AUD | 616 | NAB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 362 | | 504 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 240 | $ | 175 | SOG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 453 | AUD | 626 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 314 | $ | 227 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 428 | AUD | 598 | AZD | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 0 | | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 434 | | 598 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 434 | | 598 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 175 | | 240 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 223 | | 310 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 23 | $ (8) | $ 15 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CHF | 156 | $ | 153 | BOA | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14.820 | CHF | 15.216 | BOA | 381 | 0 | 381 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 1.319 | $ | 1.318 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.020 | | 18.228 | CBK | 226 | 0 | 226 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 17.541 | CHF | 17.909 | DUB | 350 | 0 | 350 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 476 | $ | 465 | FBF | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | | 17.118 | | 17.332 | JPM | 230 | 0 | 230 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 17.486 | CHF | 17.860 | JPM | 356 | 0 | 356 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 16.976 | $ | 17.141 | MSB | 183 | (1) | 182 | 0,01 |
| 01/2016 | | 17.118 | | 17.330 | UAG | 229 | 0 | 229 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 17.670 | CHF | 17.944 | UAG | 256 | 0 | 256 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ 17.304 | CHF 17.083 | CBK | $ 0 | $ (216) | $ (216) | (0,01) |
| 02/2016 | 17.353 | 17.118 | JPM | 0 | (230) | (230) | (0,01) |
| 02/2016 | 15.877 | 15.708 | MSB | 0 | (165) | (165) | (0,01) |
| 02/2016 | 17.350 | 17.118 | UAG | 0 | (227) | (227) | (0,01) |
| | | | | $ 2.211 | $ (854) | $ 1.357 | 0,04 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 418.053 | € 392.100 | BOA | $ 7.886 | $ 0 | $ 7.886 | 0,26 |
| 01/2016 | € 395.308 | $ 434.345 | BOA | 4.934 | (12) | 4.922 | 0,16 |
| 01/2016 | $ 523 | € 486 | BPS | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | € 467 | $ 512 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | 16.772 | 18.219 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 2.891 | € 2.687 | CBK | 33 | (5) | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | € 52.927 | $ 57.354 | CBK | 79 | (220) | (141) | 0,00 |
| 01/2016 | 107 | 115 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 277.791 | € 262.172 | GLM | 7.007 | 0 | 7.007 | 0,23 |
| 01/2016 | 419.328 | 393.486 | HUS | 8.116 | 0 | 8.116 | 0,26 |
| 01/2016 | € 394.707 | $ 433.761 | HUS | 4.991 | 0 | 4.991 | 0,16 |
| 01/2016 | 226.338 | 247.335 | JPM | 1.464 | 0 | 1.464 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 14.391 | € 13.532 | NAB | 309 | 0 | 309 | 0,01 |
| 01/2016 | € 17.316 | $ 18.812 | RBC | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 11 | € 10 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 9.225 | $ 10.107 | SCX | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| 01/2016 | 388.590 | 424.386 | UAG | 2.347 | (86) | 2.261 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 415.647 | € 391.118 | UAG | 9.225 | 0 | 9.225 | 0,30 |
| 02/2016 | 553.637 | 503.586 | BOA | 0 | (6.205) | (6.205) | (0,20) |
| 02/2016 | 434.068 | 394.707 | HUS | 0 | (4.994) | (4.994) | (0,16) |
| 02/2016 | 247.504 | 226.338 | JPM | 0 | (1.459) | (1.459) | (0,05) |
| 02/2016 | € 10 | $ 11 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 400.603 | € 366.494 | UAG | 0 | (2.199) | (2.199) | (0,07) |
| | | | | $ 46.490 | $ (15.185) | $ 31.305 | 1,02 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 31 | £ 21 | AZD | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 21 | 14 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 605 | $ 908 | BOA | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | 2 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 19.116 | £ 12.702 | BPS | 0 | (394) | (394) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 1.075 | $ 1.584 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.920 | 22.147 | CBK | 156 | 0 | 156 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 23.133 | £ 15.311 | CBK | 0 | (565) | (565) | (0,02) |
| 01/2016 | 23.125 | 15.340 | DUB | 0 | (516) | (516) | (0,02) |
| 01/2016 | £ 15.142 | $ 22.482 | JPM | 165 | 0 | 165 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 23.170 | £ 15.369 | MSB | 0 | (519) | (519) | (0,02) |
| 01/2016 | £ 14.763 | $ 21.856 | MSB | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 59 | £ 40 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 13.535 | $ 20.032 | SCX | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 289 | £ 190 | UAG | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | 21.871 | 14.737 | CBK | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| 02/2016 | 21.908 | 14.763 | JPM | 0 | (148) | (148) | 0,00 |
| 02/2016 | 21.857 | 14.763 | MSB | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| 02/2016 | 20.033 | 13.535 | SCX | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| 02/2016 | 1 | 0 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 517 | $ (2.480) | $ (1.963) | (0,06) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die E SGD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 1 | $ 1 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 86 | 60 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 28 | 20 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 52 | 37 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 2 | SGD 2 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 13 | 18 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD 49 | $ 35 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 645 | SGD 914 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.269 | 1.790 | HUS | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD 1 | $ 0 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ 6 | SGD 8 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 1.276 | 1.797 | SCX | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (23) | $ (23) | 0,00 |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 57.501 | $ 62.754 | $ (240) | $ 0 | $ (240) | (0,01) |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (1,250 %) | 21.09.2015 | 18.09.2017 | $ 815 | $ (812) | (0,03) |
| BRC | (1,000 %) | 11.05.2015 | 08.05.2017 | 2.888 | (2.869) | (0,09) |
| BRC | (1,000 %) | 03.06.2015 | 02.06.2017 | 1.100 | (1.094) | (0,03) |
| BRC | (1,000 %) | 16.06.2015 | 16.06.2017 | 1.203 | (1.196) | (0,04) |
| BRC | (1,000 %) | 02.07.2015 | 01.07.2017 | 904 | (900) | (0,03) |
| BRC | (1,000 %) | 24.11.2015 | 23.11.2017 | 8.548 | (8.539) | (0,28) |
| BRC | (1,000 %) | 10.12.2015 | 09.12.2017 | 810 | (809) | (0,03) |
| BRC | (0,750 %) | 10.12.2015 | 09.12.2017 | 1.191 | (1.190) | (0,04) |
| BRC | 2,000 % | 17.12.2015 | 16.12.2017 | 1.280 | (1.281) | (0,04) |
| CFR | (1,500 %) | 13.08.2015 | 12.08.2017 | 962 | (956) | (0,03) |
| CFR | (1,500 %) | 22.09.2015 | 09.09.2017 | 1.092 | (1.097) | (0,04) |
| CFR | (1,250 %) | 13.11.2015 | 12.11.2017 | 3.413 | (3.407) | (0,11) |
| CFR | (0,750 %) | 13.11.2015 | 11.11.2017 | 5.724 | (5.718) | (0,18) |
| GSC | (1,000 %) | 20.10.2015 | 20.10.2017 | 7.123 | (7.108) | (0,23) |
| | | | | | $ (36.976) | (1,20) |

**(m) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | (8.153) | 4.740 | (3.413) |
| BPS | 8.856 | (9.150) | (294) |
| BRC | (5.707) | 5.510 | (197) |
| CBK | (2.237) | 3.630 | 1.393 |
| DUB | 497 | (3.570) | (3.073) |
| FBF | (770) | 930 | 160 |
| GLM | 19.991 | (24.270) | (4.279) |
| GST | (5.432) | 5.561 | 129 |
| HUS | 6.439 | (8.670) | (2.231) |
| JPM | (2.706) | 2.280 | (426) |
| MSB | 3.888 | (4.000) | (112) |
| MYC | (3.846) | 3.530 | (316) |
| NAB | 314 | (320) | (6) |
| SCX | 174 | 0 | 174 |
| UAG | 8.711 | (11.160) | (2.449) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(n) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,83 | 99,65 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,03 | (0,07) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,34) | (0,89) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (0,04) | (0,03) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Markets Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 214.496.529 | $ 2.146.351 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 128.900 | 127.541 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 74.300 | 89.752 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 411.900 | 88.175 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | $ | 41.400 | 42.163 |
| Indonesia Government International Bond 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 38.300 | 37.866 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 34.400 | 33.884 |
| Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 06.03.2045 | € | 25.800 | 28.410 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 91.600 | 26.309 |
| Japan Treasury Bills (0,033)% fällig am 22.02.2016 | JPY | 2.930.000 | 23.836 |
| Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 20.600 | 21.191 |
| Corp. Nacional del Cobre de Chile 4,500 % fällig am 16.09.2025 | $ | 19.700 | 19.396 |
| Mexico Government International Bond 4,600 % fällig am 23.01.2046 | | 18.231 | 18.228 |
| Lima Metro Line 2 Finance Ltd. 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 17.800 | 17.800 |
| Barclays PLC 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 11.400 | 17.779 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 5,333 % fällig am 15.02.2028 | $ | 18.350 | 17.623 |
| Lamar Funding Ltd. 3,958 % fällig am 07.05.2025 | | 17.300 | 17.295 |
| Petrobras Global Finance BV 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 19.400 | 15.748 |
| Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust A 4,200 % fällig am 15.11.2027 | | 14.443 | 14.443 |
| Kazakhstan Government International Bond 5,125 % fällig am 21.07.2025 | | 14.400 | 14.253 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 206.956.402 | $ 2.070.900 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 128.900 | 128.235 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 411.900 | 77.864 |
| Mexico Government International Bond 6,050 % fällig am 11.01.2040 | $ | 45.674 | 54.614 |
| Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 45.600 | 50.725 |
| Petrobras Global Finance BV 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 44.100 | 44.329 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 39.550 | 44.284 |
| Morocco Government International Bond 4,250 % fällig am 11.12.2022 | | 40.080 | 40.592 |
| Indonesia Government International Bond 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 38.300 | 39.867 |
| Russia Government International Bond 7,500 % fällig am 31.03.2030 | | 35.917 | 39.630 |
| Russian Railways via RZD Capital PLC 5,739 % fällig am 03.04.2017 | | 37.108 | 37.584 |
| Turkey Government International Bond 4,125 % fällig am 11.04.2023 | € | 30.700 | 37.077 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 145.800 | 34.787 |
| Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 5,375 % fällig am 13.02.2017 | $ | 30.355 | 30.667 |
| Ecopetrol S.A. 7,625 % fällig am 23.07.2019 | | 26.965 | 30.611 |
| Mexico Government International Bond 3,000 % fällig am 06.03.2045 | € | 25.800 | 28.721 |
| Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A. 6,299 % fällig am 15.05.2017 | $ | 26.440 | 26.850 |
| Petroleos Mexicanos 5,500 % fällig am 21.01.2021 | | 23.400 | 25.094 |
| Petrobras Global Finance BV 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 24.160 | 24.856 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,400 % fällig am 24.03.2017 | | 24.325 | 24.768 |

(a) Der Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Markets Corporate Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.03.2020 (a) | $ | 3.100 | $ 3.050 | 0,49 |
| **Agile Property Holdings Ltd.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 21.05.2020 | | 400 | 418 | 0,07 |
| **Agricola Senior Trust** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.06.2020 | | 1.300 | 1.299 | 0,21 |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 11.03.2025 | | 1.800 | 1.742 | 0,28 |
| **Akbank TAS** | | | | |
| 5,125 % fällig am 31.03.2025 | | 3.100 | 2.890 | 0,46 |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 28.04.2021 | | 2.300 | 2.409 | 0,39 |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | | 2.835 | 2.468 | 0,39 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 700 | 703 | 0,11 |
| **Banco ABC Brasil S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 08.04.2020 | | 1.710 | 1.563 | 0,25 |
| **Banco Bradesco S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2022 (a) | | 1.600 | 1.500 | 0,24 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 16.01.2020 | | 2.800 | 2.089 | 0,33 |
| **Banco Continental S.A. via Continental Senior Trustees Cayman Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 18.11.2020 | | 700 | 754 | 0,12 |
| **Banco Continental SAECA** | | | | |
| 8,875 % fällig am 15.10.2017 | | 2.250 | 2.298 | 0,37 |
| **Banco de Bogota S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 19.02.2023 | | 750 | 732 | 0,12 |
| **Banco de Credito del Peru** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.04.2023 | | 4.311 | 4.327 | 0,69 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.10.2049 | | 4.450 | 2.180 | 0,35 |
| 9,000 % fällig am 29.06.2049 | | 1.590 | 1.049 | 0,17 |
| **Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 02.02.2022 | | 2.310 | 1.855 | 0,30 |
| **Banco Internacional del Peru SAA** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.10.2020 (a) | | 1.500 | 1.609 | 0,26 |
| **Banco Pan S.A.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 23.04.2020 | | 3.170 | 2.512 | 0,40 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | | 2.000 | 1.996 | 0,32 |
| **Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 3.800 | 3.805 | 0,61 |
| **BanColombia S.A.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 03.06.2021 | | 4.160 | 4.311 | 0,69 |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.09.2022 | | 3.800 | 3.895 | 0,62 |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 13.11.2024 | | 5.300 | 5.477 | 0,88 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 4.109 | 4.376 | 0,70 |
| **BOC Aviation Pte Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | | 2.000 | 1.969 | 0,32 |
| **BR Properties S.A.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 29.10.2049 | | 5.690 | 4.751 | 0,76 |
| **Burgan Tier 1 Financing Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 30.09.2049 | | 1.500 | 1.414 | 0,23 |
| **Caifu Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 24.01.2020 | | 1.300 | 1.346 | 0,22 |
| **China Cinda Finance 2015 I Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 23.04.2020 | | 2.900 | 2.834 | 0,45 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 | | 3.000 | 2.967 | 0,47 |
| **China Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.07.2075 | | 800 | 785 | 0,13 |
| **China Overseas Finance Cayman VI Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 08.05.2024 | | 1.000 | 1.123 | 0,18 |
| **China Resources Land Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.02.2024 | $ | 200 | $ 223 | 0,04 |
| **CITIC Ltd.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 17.01.2023 | | 1.300 | 1.502 | 0,24 |
| **Corpbanca S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.09.2019 | | 2.200 | 2.185 | 0,35 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 04.04.2021 | | 800 | 836 | 0,13 |
| **Emirates NBD PJSC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 28.03.2023 | | 1.600 | 1.619 | 0,26 |
| **Evergrande Real Estate Group Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 30.10.2018 | | 1.000 | 1.018 | 0,16 |
| **Finansbank** | | | | |
| 6,250 % fällig am 30.04.2019 | | 1.400 | 1.472 | 0,24 |
| **First Gulf Bank PJSC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 24.02.2020 | | 2.100 | 2.067 | 0,33 |
| **FirstRand Bank Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2020 | | 1.400 | 1.391 | 0,22 |
| **Franshion Brilliant Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 19.03.2019 | | 1.400 | 1.497 | 0,24 |
| **Global Logistic Properties Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | | 2.500 | 2.451 | 0,39 |
| **Greentown China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 04.02.2018 | | 1.710 | 1.790 | 0,29 |
| **Grupo Aval Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.09.2022 | | 1.770 | 1.667 | 0,27 |
| **Helios Towers Finance Netherlands BV** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2019 | | 5.400 | 4.274 | 0,68 |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.** | | | | |
| 6,030 % fällig am 28.06.2018 (b) | MXN | 34.709 | 170 | 0,03 |
| **HLP Finance Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.04.2021 | $ | 1.200 | 1.230 | 0,20 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | | 2.100 | 2.120 | 0,34 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.09.2025 | | 1.900 | 1.929 | 0,31 |
| **Industrial Senior Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.11.2022 | | 1.600 | 1.482 | 0,24 |
| **International Bank of Azerbaijan OJSC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 11.06.2019 | | 900 | 824 | 0,13 |
| **Interoceanica IV Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2025 | | 1.044 | 767 | 0,12 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 06.08.2022 | | 500 | 456 | 0,07 |
| 5,650 % fällig am 19.03.2022 | | 200 | 186 | 0,03 |
| 6,200 % fällig am 21.12.2021 | | 1.240 | 1.197 | 0,19 |
| **Krung Thai Bank PCL** | | | | |
| 5,200 % fällig am 26.12.2024 | | 3.000 | 3.067 | 0,49 |
| **KWG Property Holding Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 05.08.2019 | | 700 | 728 | 0,12 |
| **Longfor Properties Co. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 18.10.2019 | | 1.720 | 1.823 | 0,29 |
| **MAF Global Securities Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.10.2049 | | 1.200 | 1.220 | 0,20 |
| **National Bank of Abu Dhabi PJSC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 2.300 | 2.271 | 0,36 |
| **NBK Tier 1 Financing Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | | 3.300 | 3.284 | 0,53 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2024 | | 7.729 | 7.888 | 1,26 |
| **Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2018 | | 3.295 | 3.155 | 0,50 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 25.04.2019 | | 1.800 | 1.893 | 0,30 |
| **Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB** | | | | |
| 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 4.200 | 4.390 | 0,70 |
| **PZU Finance AB** | | | | |
| 1,375 % fällig am 03.07.2019 | € | 3.100 | 3.367 | 0,54 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2018 | $ | 2.000 | 2.015 | 0,32 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 1.400 | 1.038 | 0,17 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-3** | | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 600 | 442 | 0,07 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.02.2024 | $ | 5.800 | $ 5.119 | 0,82 |
| **Shimao Property Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 14.01.2020 (a) | | 1.150 | 1.200 | 0,19 |
| 8,375 % fällig am 10.02.2022 | | 900 | 968 | 0,15 |
| **SUAM Finance BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.04.2024 | | 1.200 | 1.221 | 0,20 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 16.10.2017 | | 1.800 | 1.922 | 0,31 |
| **Swire Pacific MTN Financing Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 09.10.2023 | | 1.400 | 1.487 | 0,24 |
| **Trust F** | | | | |
| 6,950 % fällig am 30.01.2044 | | 1.700 | 1.696 | 0,27 |
| **Turkiye Garanti Bankasi** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.10.2019 | | 3.800 | 3.786 | 0,61 |
| **Turkiye Halk Bankasi** | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.02.2021 | | 2.100 | 2.005 | 0,32 |
| **Turkiye Is Bankasi** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.04.2020 | | 3.400 | 3.376 | 0,54 |
| **Turkiye Vakiflar Bankasi TAO** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2022 (a) | | 1.500 | 1.436 | 0,23 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 19.09.2024 | | 3.800 | 3.850 | 0,62 |
| **VTB Bank OJSC Via VTB Capital S.A.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 17.10.2022 | | 4.000 | 3.830 | 0,61 |
| **Wanda Properties Overseas Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.11.2018 | | 700 | 721 | 0,12 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2024 | | 3.800 | 3.896 | 0,62 |
| **Yapi ve Kredi Bankasi** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.01.2020 (a) | | 4.200 | 4.042 | 0,65 |
| | | | 189.985 | 30,43 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 31.07.2024 | | 2.150 | 1.803 | 0,29 |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.07.2020 | | 1.000 | 987 | 0,16 |
| **Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI S.A.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 13.11.2019 | | 1.100 | 1.149 | 0,18 |
| **Afren PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 09.12.2020 (b) | | 2.537 | 51 | 0,01 |
| 10,250 % fällig am 08.04.2019 (b) | | 610 | 12 | 0,00 |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 (b) | | 27.001 | 545 | 0,09 |
| 15,000 % fällig am 25.04.2016 (g) | | 12.000 | 4.920 | 0,79 |
| **Alam Synergy Pte Ltd.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 27.03.2020 | | 2.700 | 2.281 | 0,37 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.11.2021 | | 2.200 | 2.138 | 0,34 |
| **Alliance Oil Co. Ltd.** | | | | |
| 10,000 % fällig am 11.03.2019 | | 8.035 | 4.741 | 0,76 |
| **Alpek SAB de C.V.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.11.2022 | | 1.000 | 951 | 0,15 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 03.11.2020 | | 1.300 | 1.373 | 0,22 |
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 5.800 | 5.379 | 0,86 |
| 9,875 % fällig am 15.12.2020 | | 1.170 | 1.249 | 0,20 |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 16.07.2022 | | 4.000 | 3.942 | 0,63 |
| 6,125 % fällig am 30.03.2040 | | 1.550 | 1.716 | 0,28 |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2022 | | 2.650 | 2.117 | 0,34 |
| **Aralco Finance S.A.** | | | | |
| 10,125 % fällig am 07.05.2020 (b) | | 2.030 | 18 | 0,00 |
| **Arcelik** | | | | |
| 5,000 % fällig am 03.04.2023 | | 1.050 | 961 | 0,15 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 02.05.2022 | | 1.200 | 1.002 | 0,16 |
| **BRF S.A.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 22.05.2023 | | 1.000 | 907 | 0,15 |
| **CAR, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 11.02.2021 | | 400 | 402 | 0,06 |
| **CCCI Treasure Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2049 | | 2.300 | 2.268 | 0,36 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Celulosa Arauco y Constitucion S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2024 | $ | 1.300 | $ 1.292 | 0,21 |
| 4,750 % fällig am 11.01.2022 | | 700 | 714 | 0,11 |
| **Cemex SAB de C.V.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.03.2023 | € | 1.800 | 1.780 | 0,29 |
| 4,750 % fällig am 11.01.2022 | | 1.100 | 1.117 | 0,18 |
| 5,700 % fällig am 11.01.2025 | $ | 900 | 755 | 0,12 |
| **Cencosud S.A.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 12.02.2025 | | 5.500 | 5.122 | 0,82 |
| **China Merchants Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.05.2022 | | 800 | 843 | 0,14 |
| **China State Construction Finance Cayman I Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 02.04.2018 | | 1.800 | 1.807 | 0,29 |
| **Cielo S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.11.2022 | | 1.020 | 847 | 0,14 |
| **CIMPOR Financial Operations BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | | 7.054 | 4.761 | 0,76 |
| **CNOOC Curtis Funding No.1 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 1.000 | 1.035 | 0,17 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 14.05.2019 | | 2.000 | 2.000 | 0,32 |
| 3,400 % fällig am 16.04.2023 | | 200 | 194 | 0,03 |
| **Coca-Cola Femsa SAB de C.V.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 26.11.2023 | | 1.800 | 1.812 | 0,29 |
| **Columbus International, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.03.2021 | | 3.600 | 3.577 | 0,57 |
| **Comcel Trust via Comunicaciones Celulares S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 06.02.2024 | | 1.500 | 1.162 | 0,19 |
| **ContourGlobal Power Holdings S.A.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.06.2019 | | 1.500 | 1.429 | 0,23 |
| **Corporation GEO SAB de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 (b) | | 850 | 18 | 0,00 |
| **CRCC Yupeng Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 28.02.2049 | | 1.500 | 1.524 | 0,24 |
| **CSN Islands XI Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.09.2019 | | 1.310 | 694 | 0,11 |
| **Digicel Group Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.09.2020 | | 13.200 | 10.956 | 1,75 |
| **DP World Ltd.** | | | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 6.700 | 6.616 | 1,06 |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.06.2026 | | 1.300 | 1.110 | 0,18 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 6.600 | 5.560 | 0,89 |
| **Embraer Netherlands Finance BV** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.06.2025 | | 1.000 | 912 | 0,15 |
| **Evraz, Inc. N.A. Canada** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.11.2019 | | 3.400 | 3.196 | 0,51 |
| **Fibria Overseas Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.05.2024 | | 1.100 | 1.048 | 0,17 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2020 | | 3.500 | 2.275 | 0,36 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2021 | | 2.000 | 1.265 | 0,20 |
| **Flextronics International Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2025 | | 1.500 | 1.464 | 0,23 |
| **Fomento Economico Mexicano SAB de C.V.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.05.2023 | | 1.600 | 1.498 | 0,24 |
| **Formosa Group Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 22.04.2025 | | 3.500 | 3.361 | 0,54 |
| **Fresnillo PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 13.11.2023 | | 1.500 | 1.515 | 0,24 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 3.250 | 2.437 | 0,39 |
| **Grupo Bimbo SAB de C.V.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.06.2024 | | 750 | 732 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 25.01.2022 | | 1.200 | 1.233 | 0,20 |
| **Grupo KUO SAB de C.V.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 04.12.2022 | | 1.650 | 1.539 | 0,25 |
| **Grupo Posadas S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 30.06.2022 | | 3.000 | 2.884 | 0,46 |
| **Grupo Televisa SAB** | | | | |
| 6,125 % fällig am 31.01.2046 | | 3.600 | 3.597 | 0,58 |
| **GTL Trade Finance, Inc.** | | | | |
| 5,893 % fällig am 29.04.2024 | | 802 | 573 | 0,09 |
| 7,250 % fällig am 16.04.2044 | | 2.200 | 1.430 | 0,23 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | $ | 900 | $ 698 | 0,11 |
| **Hikma Pharmaceuticals PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.04.2020 | | 1.700 | 1.653 | 0,27 |
| **HKT Capital No.2 Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 02.04.2025 | | 1.800 | 1.761 | 0,28 |
| **Hutchison Whampoa International 14 Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 31.10.2024 | | 5.650 | 5.617 | 0,90 |
| **Inversiones CMPC S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2024 | | 3.600 | 3.483 | 0,56 |
| **Israel Chemicals Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.12.2024 | | 3.000 | 3.014 | 0,48 |
| **JB y Compania S.A. de C.V.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 13.05.2025 | | 1.500 | 1.436 | 0,23 |
| **JBS Investments GmbH** | | | | |
| 7,750 % fällig am 28.10.2020 | | 300 | 290 | 0,05 |
| **JBS USA LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2025 | | 1.600 | 1.400 | 0,22 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.11.2019 | | 4.300 | 3.271 | 0,52 |
| **KOC Holding** | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.04.2020 | | 1.700 | 1.632 | 0,26 |
| **Kosmos Energy Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.08.2021 | | 2.030 | 1.644 | 0,26 |
| **Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust A** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.11.2027 | | 2.550 | 2.397 | 0,38 |
| **Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust B** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.11.2023 | | 1.150 | 1.061 | 0,17 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 08.05.2019 | | 1.000 | 1.035 | 0,17 |
| **Lima Metro Line 2 Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 1.600 | 1.560 | 0,25 |
| **Marfrig Holdings Europe BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.06.2019 | | 1.700 | 1.522 | 0,24 |
| **MCE Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | | 2.460 | 2.251 | 0,36 |
| **Metalloinvest Finance Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.04.2020 | | 1.800 | 1.736 | 0,28 |
| **Metinvest BV** | | | | |
| 8,750 % fällig am 14.02.2018 | | 4.250 | 1.896 | 0,30 |
| **Mexichem SAB de C.V.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 17.09.2044 | | 1.000 | 843 | 0,14 |
| **MHP S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 02.04.2020 | | 1.800 | 1.566 | 0,25 |
| **Minerva Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 31.01.2023 | | 400 | 378 | 0,06 |
| **MMC Norilsk Nickel OJSC via MMC Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 14.10.2022 | | 1.800 | 1.837 | 0,29 |
| **Mobile Telesystems OJSC via MTS International Funding Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.05.2023 | | 2.000 | 1.855 | 0,30 |
| **MTN Mauritius Investments Ltd.** | | | | |
| 4,755 % fällig am 11.11.2024 | | 3.600 | 3.159 | 0,51 |
| **Myriad International Holdings BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.07.2025 | | 7.600 | 7.343 | 1,18 |
| **OCP S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.10.2025 | | 8.100 | 7.574 | 1,21 |
| **Odebrecht Finance Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 26.06.2042 | | 2.250 | 1.164 | 0,19 |
| **Offshore Drilling Holding S.A.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 20.09.2020 | | 500 | 359 | 0,06 |
| **Oil India Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 17.04.2024 (a) | | 1.100 | 1.177 | 0,19 |
| **Pacific Exploration & Production Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.01.2019 | | 5.600 | 1.092 | 0,18 |
| **Petra Diamonds US Treasury PLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 31.05.2020 | | 3.200 | 2.632 | 0,42 |
| **Phosagro OAO via Phosagro Bond Funding Ltd.** | | | | |
| 4,204 % fällig am 13.02.2018 | | 100 | 99 | 0,02 |
| **Polyus Gold International Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.04.2020 | | 2.050 | 1.973 | 0,32 |
| **Proven Honour Capital Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 19.05.2025 | | 700 | 690 | 0,11 |
| **PTT Exploration & Production PCL** | | | | |
| 4,875 % fällig am 29.12.2049 | | 6.000 | 5.865 | 0,94 |
| **PTT Global Chemical PCL** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.09.2022 | $ | 1.600 | $ 1.641 | 0,26 |
| **PTT PCL** | | | | |
| 3,375 % fällig am 25.10.2022 | | 1.800 | 1.782 | 0,29 |
| **QGOG Constellation S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 09.11.2019 | | 10.050 | 4.548 | 0,73 |
| **Reliance Industries Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 28.01.2025 | | 4.800 | 4.714 | 0,76 |
| **Sable International Finance Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.08.2022 | | 1.800 | 1.746 | 0,28 |
| **SACI Falabella** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.01.2025 | | 2.000 | 1.987 | 0,32 |
| **Samarco Mineracao S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.09.2024 | | 1.300 | 436 | 0,07 |
| **San Miguel Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 26.04.2023 | | 1.400 | 1.309 | 0,21 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.06.2032 | | 2.805 | 2.588 | 0,41 |
| **Semiconductor Manufacturing International Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.10.2019 | | 2.300 | 2.306 | 0,37 |
| **SM Investments Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.06.2024 | | 2.500 | 2.525 | 0,40 |
| **Southern Copper Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 08.11.2042 | | 5.150 | 3.740 | 0,60 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | | 2.600 | 2.522 | 0,40 |
| **Suzano Trading Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.01.2021 | | 600 | 584 | 0,09 |
| **Tata Motors Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.04.2020 | | 700 | 712 | 0,11 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 11.02.2025 | | 1.900 | 1.866 | 0,30 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | € | 250 | 258 | 0,04 |
| 1,875 % fällig am 31.03.2027 | | 2.250 | 2.228 | 0,36 |
| **Thai Oil PCL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.01.2023 | $ | 3.500 | 3.440 | 0,55 |
| **Topaz Marine S.A.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 01.11.2018 | | 2.100 | 1.931 | 0,31 |
| **Transportadora de Gas Internacional S.A. ESP** | | | | |
| 5,700 % fällig am 20.03.2022 | | 2.000 | 2.015 | 0,32 |
| **Tullow Oil PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2020 | | 3.430 | 2.401 | 0,38 |
| **Turk Telekomunikasyon** | | | | |
| 4,875 % fällig am 19.06.2024 | | 2.000 | 1.899 | 0,30 |
| **Turkcell Iletisim Hizmetleri** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2025 | | 2.250 | 2.179 | 0,35 |
| **Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari** | | | | |
| 4,250 % fällig am 09.05.2020 | | 1.300 | 1.251 | 0,20 |
| **TV Azteca SAB de C.V.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 18.09.2020 | | 350 | 206 | 0,03 |
| **Union Andina de Cementos SAA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2021 | | 2.500 | 2.419 | 0,39 |
| **USJ Acucar e Alcool S.A.** | | | | |
| 9,875 % fällig am 09.11.2019 | | 4.330 | 1.705 | 0,27 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.01.2022 (a) | | 2.150 | 1.630 | 0,26 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 1.000 | 700 | 0,11 |
| **Vale S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 11.09.2042 | | 350 | 233 | 0,04 |
| **Vedanta Resources PLC** | | | | |
| 7,125 % fällig am 31.05.2023 | | 510 | 282 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 07.06.2021 (a) | | 2.870 | 1.684 | 0,27 |
| **Volcan Cia Minera SAA** | | | | |
| 5,375 % fällig am 02.02.2022 | | 1.100 | 704 | 0,11 |
| **Votorantim Cimentos S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 05.04.2041 | | 2.400 | 1.836 | 0,29 |
| **VTR Finance BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2024 | | 4.400 | 4.059 | 0,65 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 3.341 | 2.957 | 0,47 |
| **YPF S.A.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 28.07.2025 | | 6.700 | 6.415 | 1,03 |
| **Zhaikmunai LLP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 14.02.2019 | | 319 | 251 | 0,04 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,125 % fällig am 13.11.2019 | $ | 3.800 | $ 2.974 | 0,48 |
| | | | 288.222 | 46,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Abu Dhabi National Energy Co. PJSC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 12.01.2023 | | 4.400 | 4.225 | 0,68 |
| **Bharti Airtel International Netherlands BV** | | | | |
| 5,350 % fällig am 20.05.2024 | | 2.300 | 2.423 | 0,39 |
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | | 1.500 | 1.469 | 0,24 |
| **Borets Finance Ltd.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 26.09.2018 | | 3.078 | 2.533 | 0,41 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | | 1.500 | 1.189 | 0,19 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 1.700 | 1.694 | 0,27 |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | | 2.700 | 2.730 | 0,44 |
| **Colbun S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.07.2024 | | 2.700 | 2.643 | 0,42 |
| **Colombia Telecomunicaciones S.A. ESP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.09.2022 | | 1.200 | 1.086 | 0,17 |
| 8,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.100 | 949 | 0,15 |
| **Comision Federal de Electricidad** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 1.705 | 1.688 | 0,27 |
| **Empresa Electrica Angamos S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.05.2029 | | 3.500 | 3.133 | 0,50 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 3.600 | 3.197 | 0,51 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 13.200 | 12.490 | 2,00 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 1.000 | 1.125 | 0,18 |
| **Globo Comunicacao e Participacoes S.A.** | | | | |
| 4,843 % fällig am 08.06.2025 | | 2.835 | 2.566 | 0,41 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.08.2019 | | 800 | 842 | 0,13 |
| **Indo Energy Finance II BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.01.2023 | | 2.200 | 916 | 0,15 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.11.2024 | $ | 7.100 | $ 7.258 | 1,16 |
| **Lamar Funding Ltd.** | | | | |
| 3,958 % fällig am 07.05.2025 | | 2.300 | 2.055 | 0,33 |
| **Listrindo Capital BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 21.02.2019 | | 400 | 411 | 0,07 |
| **Millicom International Cellular S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2020 | | 400 | 360 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 15.03.2025 | | 4.200 | 3.591 | 0,58 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.** | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 1.500 | 1.333 | 0,21 |
| **NTPC Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 03.10.2022 | | 1.300 | 1.360 | 0,22 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 7.443 | 1.712 | 0,27 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 5.540 | 1.330 | 0,21 |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.02.2023 | | 6.400 | 6.240 | 1,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 4.600 | 3.622 | 0,58 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 3.000 | 1.957 | 0,31 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | | 1.800 | 1.989 | 0,32 |
| **Sixsigma Networks Mexico S.A. de C.V.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 07.11.2021 | | 550 | 528 | 0,08 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 27.03.2020 | | 1.500 | 1.426 | 0,23 |
| **Telemar Norte Leste S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.10.2020 | | 1.900 | 1.007 | 0,16 |
| **Terraform Global Operating LLC** | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | | 1.450 | 1.163 | 0,19 |
| **VimpelCom Holdings BV** | | | | |
| 7,504 % fällig am 01.03.2022 | | 4.340 | 4.362 | 0,70 |
| | | | 88.602 | 14,19 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 566.809 | 90,78 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Africa Finance Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 29.04.2020 | $ | 2.500 | $ 2.516 | 0,40 |
| **African Export-Import Bank** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.07.2019 | | 1.600 | 1.644 | 0,27 |
| | | | 4.160 | 0,67 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.** | | 332.624 | 0 | 0,00 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| **Henan Shuanghui Investment & Development Co. Ltd.** | | 20.000 | 63 | 0,01 |
| **FINANCIALS** | | | | |
| **National Bank of Greece S.A.** | | 11.795.550 | 4.358 | 0,70 |
| | | | 4.421 | 0,71 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (c)** | | 1.000 | 101 | 0,01 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 5.506.556 | 55.077 | 8,82 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 630.568** | **100,99** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 56 | $ (6) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (6)** | **0,00** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 13.900 | $ 37 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | 21.000 | 134 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 6.800 | (378) | (0,06) |
| | | | | | $ (207) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (207)** | **(0,03)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | JPM | JPY 91,000 | 18.02.2016 | $ 3.763 | $ (96) | $ 0 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | $ 7.800 | $ 59 | $ 171 | $ (112) | 0,01 |
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | CBK | 7.700 | 58 | 157 | (99) | 0,01 |
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 6.400 | 49 | 133 | (84) | 0,01 |
| AK Transneft OAO | 1,000 % | 20.03.2017 | CBK | 8.700 | (189) | (128) | (61) | (0,03) |
| Altice Finco S.A. | 5,000 % | 20.06.2019 | GST | € 1.100 | 43 | 75 | (32) | 0,01 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | $ 2.300 | 2 | 16 | (14) | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2019 | BPS | 5.100 | (365) | (307) | (58) | (0,06) |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 5.700 | (138) | (137) | (1) | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 13.300 | (323) | (114) | (209) | (0,05) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 6.400 | (156) | (66) | (90) | (0,03) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.03.2019 | BPS | 11.100 | (557) | (215) | (342) | (0,09) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 2.800 | (140) | (71) | (69) | (0,02) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 4.700 | (236) | (87) | (149) | (0,04) |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 7.800 | 63 | 144 | (81) | 0,01 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BRC | 7.700 | 62 | 111 | (49) | 0,01 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 6.400 | 51 | 110 | (59) | 0,01 |
| | | | | | $ (1.717) | $ (208) | $ (1.509) | (0,27) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 17 | € | 16 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 100 | | 92 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 58.100 | $ | 476 | GLM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 480 | JPY | 58.100 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 360 | $ | 392 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 10.906 | | 11.725 | JPM | 0 | (133) | (133) | (0,02) |
| 02/2016 | JPY | 58.100 | | 480 | MSB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 1.219 | | 71 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 8.618 | | 1.320 | JPM | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | | | | | | $ 49 | $ (143) | $ (94) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (1.811)** | **(0,29)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 628.544** | **100,67** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 57 | $ 83 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 28 | 28 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 67 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 775 | 775 | 0,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 4 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 242 | 242 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 4 | 4 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 233 | 233 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 130 | $ 93 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 96 | 105 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 18 | 26 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 28 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 1.607** | **0,26** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (5.798)** | **(0,93)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 624.353** | **100,00** |

ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 15.202 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(c) **Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.030 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(e) **Barmittel in Höhe von USD 1.463 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Barmittel in Höhe von USD 358 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 15,000 % | 25.04.2016 | 30.04.2015 | $ 11.584 | $ 4.920 | 0,79 |

(h) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 55.178 | $ 569.533 | $ 5.857 | $ 630.568 |
| Finanzderivate[3] | (6) | (2.018) | 0 | (2.024) |
| **Summen** | **$ 55.172** | **$ 567.515** | **$ 5.857** | **$ 628.544** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 81.212 | $ 1.007.527 | $ 2.543 | $ 1.091.282 |
| Finanzderivate[3] | 1.261 | (7.121) | 0 | (5.860) |
| **Summen** | **$ 82.473** | **$ 1.000.406** | **$ 2.543** | **$ 1.085.422** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(i) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 14.856 | CHF 15.253 | BOA | $ 382 | $ 0 | $ 382 | 0,06 |
| 01/2016 | CHF 616 | $ 607 | BOA | 1 | (10) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | 780 | 769 | BPS | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | 898 | 897 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.524 | 14.692 | CBK | 183 | 0 | 183 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 16.274 | CHF 16.616 | DUB | 325 | 0 | 325 | 0,05 |
| 01/2016 | CHF 48 | $ 47 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.237 | CHF 1.273 | FBF | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 451 | $ 440 | FBF | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | 14.062 | 14.237 | JPM | 189 | 0 | 189 | 0,03 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 14.933 | CHF 15.253 | JPM | $ 304 | $ 0 | $ 304 | 0,05 |
| 01/2016 | CHF 20.314 | $ 20.325 | MSB | 166 | (136) | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | 89 | 90 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 120 | 122 | SOG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 16.401 | CHF 16.655 | UAG | 238 | 0 | 238 | 0,04 |
| 01/2016 | CHF 14.062 | $ 14.236 | UAG | 188 | 0 | 188 | 0,03 |
| 02/2016 | 200 | 203 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 14.325 | CHF 14.142 | CBK | 0 | (179) | (179) | (0,03) |
| 02/2016 | 14.255 | 14.062 | JPM | 0 | (189) | (189) | (0,03) |
| 02/2016 | CHF 285 | $ 288 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 13.082 | CHF 12.943 | MSB | 0 | (136) | (136) | (0,02) |
| 02/2016 | 14.252 | 14.062 | UAG | 0 | (187) | (187) | (0,03) |
| | | | | $ 2.020 | $ (857) | $ 1.163 | 0,18 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class S EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 42.426 | $ 46.600 | BOA | $ 525 | $ (12) | $ 513 | 0,08 |
| 01/2016 | $ 48.512 | € 45.500 | BOA | 915 | 0 | 915 | 0,15 |
| 01/2016 | € 430 | $ 471 | BPS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | 3.426 | 3.721 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 6.213 | 6.762 | CBK | 46 | (32) | 14 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 29 | € 27 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 26.372 | 24.889 | GLM | 665 | 0 | 665 | 0,11 |
| 01/2016 | 48.545 | 45.554 | HUS | 940 | 0 | 940 | 0,15 |
| 01/2016 | € 41.972 | $ 46.125 | HUS | 531 | 0 | 531 | 0,08 |
| 01/2016 | 24.921 | 27.233 | JPM | 161 | 0 | 161 | 0,03 |
| 01/2016 | 70 | 74 | NAB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 355 | 387 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 3 | € 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 1.466 | $ 1.606 | SCX | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 48.230 | € 45.384 | UAG | 1.070 | 0 | 1.070 | 0,17 |
| 01/2016 | € 43.528 | $ 47.531 | UAG | 258 | (12) | 246 | 0,04 |
| 02/2016 | $ 46.152 | € 41.972 | BOA | 0 | (525) | (525) | (0,08) |
| 02/2016 | € 1.282 | $ 1.408 | BOA | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 46.158 | € 41.972 | HUS | 0 | (531) | (531) | (0,09) |
| 02/2016 | 27.252 | 24.921 | JPM | 0 | (161) | (161) | (0,03) |
| 02/2016 | € 2 | $ 3 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 46.524 | € 42.562 | UAG | 0 | (255) | (255) | (0,04) |
| | | | | $ 5.146 | $ (1.530) | $ 3.616 | 0,58 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 9 | $ 14 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 218 | £ 145 | BPS | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 18 | $ 27 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 168 | 249 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 257 | £ 170 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | 257 | 171 | DUB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 168 | $ 249 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 257 | £ 171 | MSB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 164 | $ 242 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 151 | 223 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | 3 | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 243 | £ 164 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 243 | 164 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 242 | 164 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 223 | 151 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 6 | $ (28) | $ (22) | 0,00 |

**(j) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class S EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 13.883 | $ 15.151 | $ (58) | $ 0 | $ (58) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(k) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (2,750 %) | 03.11.2015 | 30.10.2017 | $ 879 | $ (875) | (0,14) |
| BPS | (1,350 %) | 23.09.2015 | 22.09.2017 | 2.939 | (2.928) | (0,47) |
| BPS | (1,250 %) | 30.07.2015 | 29.07.2017 | 297 | (296) | (0,05) |
| BRC | (2,000 %) | 09.09.2015 | 08.09.2017 | 1.204 | (1.196) | (0,19) |
| BRC | (2,000 %) | 08.12.2015 | 08.12.2017 | 818 | (817) | (0,13) |
| BRC | (1,500 %) | 10.12.2015 | 09.12.2017 | 1.436 | (1.435) | (0,23) |
| BRC | (1,250 %) | 30.11.2015 | 30.11.2017 | 797 | (795) | (0,13) |
| BRC | (1,250 %) | 10.12.2015 | 09.12.2017 | 2.956 | (2.954) | (0,47) |
| BRC | (1,000 %) | 22.10.2015 | 21.10.2017 | 1.620 | (1.616) | (0,26) |
| CFR | (1,250 %) | 05.10.2015 | 02.10.2017 | 451 | (449) | (0,07) |
| CFR | (1,000 %) | 05.11.2015 | 04.11.2017 | 1.066 | (1.064) | (0,17) |
| CFR | (1,500 %) | 05.11.2015 | 04.11.2017 | 1.396 | (1.393) | (0,22) |
| | | | | | $ (15.818) | (2,53) |

**(l) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.093 | $ (1.730) | $ (637) |
| BPS | (932) | 960 | 28 |
| BRC | (78) | 0 | (78) |
| CBK | (118) | 60 | (58) |
| DUB | 319 | (640) | (321) |
| FBF | 25 | 0 | 25 |
| GLM | 600 | (1.330) | (730) |
| GST | (249) | 0 | (249) |
| HUS | 942 | (1.210) | (268) |
| JPM | 81 | (270) | (189) |
| MSB | (112) | 10 | (102) |
| NAB | (2) | 0 | (2) |
| RBC | 3 | 0 | 3 |
| SCX | 14 | 0 | 14 |
| SOG | 2 | 0 | 2 |
| UAG | 1.300 | (1.990) | (690) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(m) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 100,99 | 98,93 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,00 | 0,11 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,03) | (0,14) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,29) | (0,50) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Markets Corporate Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 62.467.027 | $ 625.081 |
| | **PARI (000S)** | |
| Myriad International Holdings BV | | |
| 5,500 % fällig am 21.07.2025 | $ 18.500 | 18.497 |
| Global Logistic Properties Ltd. | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | 16.000 | 15.876 |
| ADCB Finance Cayman Ltd. | | |
| 2,625 % fällig am 10.03.2020 | 11.600 | 11.551 |
| Afren PLC | | |
| 15,000 % fällig am 25.04.2016 | 12.000 | 11.340 |
| DP World Ltd. | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | 8.900 | 10.006 |
| OCP S.A. | | |
| 4,500 % fällig am 22.10.2025 | 10.100 | 9.898 |
| Federal Home Loan Bank | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | 8.800 | 8.799 |
| YPF S.A. | | |
| 8,500 % fällig am 28.07.2025 | 8.100 | 8.028 |
| Reliance Industries Ltd. | | |
| 4,125 % fällig am 28.01.2025 | 7.600 | 7.524 |
| NBK Tier 1 Financing Ltd. | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | 7.300 | 7.300 |
| Cencosud S.A. | | |
| 5,150 % fällig am 12.02.2025 | 7.200 | 7.200 |
| Hikma Pharmaceuticals PLC | | |
| 4,250 % fällig am 10.04.2020 | 7.200 | 7.162 |
| Petrobras Global Finance BV | | |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | 9.000 | 6.965 |
| Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2027 | 6.800 | 6.800 |
| Bharti Airtel Ltd. | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | 6.800 | 6.753 |
| Southern Copper Corp. | | |
| 5,875 % fällig am 23.04.2045 | 6.600 | 6.523 |
| Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2024 | 6.300 | 6.516 |
| Federal Home Loan Bank | | |
| 0,000 % fällig am 28.10.2015 | 6.500 | 6.498 |
| AngloGold Ashanti Holdings PLC | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2022 | 6.800 | 6.454 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 64.147.328 | $ 641.900 |
| | **PARI (000S)** | |
| Sibur Securities Ltd. | | |
| 3,914 % fällig am 31.01.2018 | $ 28.000 | 24.921 |
| Alliance Oil Co. Ltd. | | |
| 10,000 % fällig am 11.03.2019 | 22.700 | 18.402 |
| Alpha Star Holding Ltd. | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | 18.600 | 16.771 |
| VimpelCom Holdings BV | | |
| 7,504 % fällig am 01.03.2022 | 16.700 | 16.604 |
| EDC Finance Ltd. | | |
| 4,875 % fällig am 17.04.2020 | 17.250 | 14.807 |
| EuroChem Mineral & Chemical Co. OJSC via EuroChem Global Investments Ltd. | | |
| 5,125 % fällig am 12.12.2017 | 15.420 | 13.732 |
| Metalloinvest Finance Ltd. | | |
| 5,625 % fällig am 17.04.2020 | 15.370 | 13.647 |
| Global Logistic Properties Ltd. | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | 13.500 | 13.325 |
| Zhaikmunai LLP | | |
| 7,125 % fällig am 13.11.2019 | 14.040 | 12.140 |
| Agromercantil Senior Trust | | |
| 6,250 % fällig am 10.04.2019 | 11.700 | 11.987 |
| Reliance Holding USA, Inc. | | |
| 4,500 % fällig am 19.10.2020 | 9.800 | 10.404 |
| EDC Finance Ltd. | | |
| 4,875 % fällig am 17.04.2020 | 12.300 | 10.015 |
| Tullow Oil PLC | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2020 | 11.770 | 9.487 |
| | **AKTIEN** | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | 930.729 | 9.317 |
| | **PARI (000S)** | |
| Southern Copper Corp. | | |
| 5,250 % fällig am 08.11.2042 | $ 10.400 | 9.088 |
| Cable Communications Systems NV | | |
| 7,500 % fällig am 01.11.2020 | € 7.700 | 9.009 |
| Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A. | | |
| 7,375 % fällig am 02.02.2022 | $ 8.950 | 8.972 |
| CITGO Petroleum Corp. | | |
| 6,250 % fällig am 15.08.2022 | 8.600 | 8.868 |
| Federal Home Loan Bank | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | 8.800 | 8.799 |

(a) Der Emerging Markets Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BERMUDAS** | | | | |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.10.2016 | $ | 200 | $ 202 | 0,19 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.01.2016 | € | 4.100 | 4.456 | 4,24 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | $ | 600 | 608 | 0,58 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2016 | | 200 | 200 | 0,19 |
| **Caixa Economica Federal** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.11.2017 | | 500 | 461 | 0,44 |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | | 150 | 139 | 0,13 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 26.05.2018 | | 600 | 572 | 0,55 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 1.800 | 1.760 | 1,67 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 1.100 | 1.086 | 1,03 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 3.300 | 2.516 | 2,39 |
| | | | 11.798 | 11,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | | 200 | 198 | 0,19 |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 500 | 494 | 0,47 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | BRL | 8.300 | 2.029 | 1,93 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 10.900 | 2.471 | 2,35 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 8.000 | 1.747 | 1,66 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2017 | | 20.700 | 4.180 | 3,98 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2018 | | 2.700 | 466 | 0,44 |
| | | | 11.585 | 11,02 |
| Summe Brasilien | | | 23.383 | 22,24 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 900 | 896 | 0,85 |
| **KANADA** | | | | |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 0,856 % fällig am 23.07.2018 | | 1.000 | 997 | 0,95 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 0,932 % fällig am 28.11.2017 | | 200 | 198 | 0,19 |
| 1,625 % fällig am 28.11.2017 | | 500 | 494 | 0,47 |
| **Anstock II Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.07.2017 | | 1.600 | 1.581 | 1,50 |
| **Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 79 | 29 | 0,03 |
| **Pemex Finance Ltd.** | | | | |
| 9,150 % fällig am 15.11.2018 | | 750 | 811 | 0,77 |
| | | | 3.113 | 2,96 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,221 % fällig am 11.04.2017 | | 200 | 198 | 0,19 |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 200 | 200 | 0,19 |
| | | | 398 | 0,38 |
| **CHINA** | | | | |
| **Agricultural Bank Of China** | | | | |
| 1,288 % fällig am 21.05.2018 | | 1.200 | 1.200 | 1,14 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | | 1.500 | 1.498 | 1,43 |
| | | | 2.698 | 2,57 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.05.2022 | COP | 63.000 | $ 19 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 15.06.2016 | | 6.897.000 | 2.188 | 2,08 |
| 7,500 % fällig am 26.08.2026 | | 250.000 | 73 | 0,07 |
| | | | 2.280 | 2,17 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 11.000 | 446 | 0,42 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,047 % fällig am 12.06.2017 | $ | 800 | 798 | 0,76 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,882 % fällig am 30.05.2017 | | 200 | 199 | 0,19 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **CNOOC Finance 2013 Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.05.2016 | | 1.000 | 998 | 0,95 |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 200 | 199 | 0,19 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 16.04.2016 | | 1.600 | 1.600 | 1,52 |
| | | | 2.797 | 2,66 |
| **INDIEN** | | | | |
| **HDFC Bank Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.11.2016 | | 2.000 | 2.022 | 1,92 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 2,467 % fällig am 21.01.2016 | | 2.000 | 2.000 | 1,90 |
| | | | 4.022 | 3,82 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 09.03.2017 | | 300 | 318 | 0,30 |
| 6,875 % fällig am 17.01.2018 | | 1.010 | 1.098 | 1,05 |
| 11,625 % fällig am 04.03.2019 | | 700 | 881 | 0,84 |
| **Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.04.2017 | | 200 | 202 | 0,19 |
| | | | 2.499 | 2,38 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **IRLAND** | | | | |
| **PIMCO China Bond Fund (a)** | | 254.228 | 2.817 | 2,68 |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 33.000 | 3.320 | 3,16 |
| | | | 6.137 | 5,84 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ISRAEL** | | | | |
| **Delek & Avner Tamar Bond Ltd.** | | | | |
| 2,803 % fällig am 30.12.2016 | $ | 200 | 200 | 0,19 |
| **JAPAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,028 %) fällig am 22.02.2016 | JPY | 1.470.000 | 12.220 | 11,62 |
| Summe Japan | | | 12.220 | 11,62 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **Intergas Finance BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 14.05.2017 | $ | 408 | 418 | 0,40 |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | | |
| 9,125 % fällig am 02.07.2018 | | 100 | 110 | 0,11 |
| **Samruk-Energy JSC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 1.130 | 1.107 | 1,05 |
| | | | 1.635 | 1,56 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 23.05.2016 | $ | 600 | $ 605 | 0,58 |
| 6,212 % fällig am 22.11.2016 | | 300 | 309 | 0,29 |
| | | | 914 | 0,87 |
| **MARSHALLINSELN** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | | 100 | 110 | 0,10 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.06.2019 | MXN | 7.200 | 417 | 0,40 |
| 9,000 % fällig am 15.01.2016 | | 7.100 | 412 | 0,39 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | | |
| 3,460 % fällig am 26.05.2016 | | 391.000 | 2.232 | 2,12 |
| 3,480 % fällig am 28.04.2016 | | 220.000 | 1.260 | 1,20 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,335 % fällig am 18.07.2018 | $ | 1.000 | 991 | 0,94 |
| **Telefonos de Mexico SAB de C.V.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 31.01.2016 | MXN | 5.400 | 314 | 0,30 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos SAB de C.V.** | | | | |
| 8,330 % fällig am 09.12.2014 (b) | | 5.000 | 23 | 0,02 |
| | | | 5.649 | 5,37 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 11.05.2016 | $ | 200 | 202 | 0,19 |
| **PERU** | | | | |
| **BBVA Banco Continental S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.04.2018 | | 200 | 201 | 0,19 |
| **POLEN** | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 25.10.2017 | PLN | 200 | 54 | 0,05 |
| **KATAR** | | | | |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | $ | 185 | 189 | 0,18 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,071 % fällig am 14.01.2017 | | 300 | 301 | 0,29 |
| 1,376 % fällig am 17.09.2016 | | 400 | 401 | 0,38 |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 1,375 % fällig am 05.02.2016 | | 700 | 700 | 0,67 |
| 4,875 % fällig am 14.01.2016 | | 200 | 200 | 0,19 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | | 1.200 | 1.199 | 1,14 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 27.10.2016 | | 200 | 204 | 0,19 |
| **Shinhan Bank** | | | | |
| 0,968 % fällig am 08.04.2017 | | 200 | 200 | 0,19 |
| | | | 3.205 | 3,05 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **Export Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2019 | | 200 | 207 | 0,20 |
| **Turkiye Garanti Bankasi** | | | | |
| 2,817 % fällig am 20.04.2016 | | 200 | 200 | 0,19 |
| | | | 407 | 0,39 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 400 | 591 | 0,56 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,390 % fällig am 25.07.2023 | $ | 3 | 2 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 14.05.2018 | $ | 400 | $ 398 | 0,38 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 75 | 75 | 0,07 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 1.000 | 62 | 0,06 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | $ | 250 | 253 | 0,24 |
| **ConAgra Foods, Inc.** | | | | |
| 0,687 % fällig am 21.07.2016 | | 100 | 100 | 0,10 |
| **Cox Communications, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2016 | | 100 | 104 | 0,10 |
| **Dell, Inc.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 01.04.2016 | | 200 | 201 | 0,19 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.02.2016 | | 200 | 200 | 0,19 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 300 | 301 | 0,29 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 200 | 203 | 0,19 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2016 | | 300 | 303 | 0,29 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2016 | | 200 | 204 | 0,19 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 100 | 100 | 0,10 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 0,972 % fällig am 03.03.2017 | | 100 | 100 | 0,09 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2017 | | 100 | 103 | 0,10 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 0,716 % fällig am 02.06.2017 | | 300 | 299 | 0,28 |
| 1,200 % fällig am 22.07.2020 | | 1.200 | 1.197 | 1,14 |
| | | | 4.203 | 4,00 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,677 % fällig am 25.07.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (b) | | 33 | $ 30 | 0,03 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | | 41 | 38 | 0,04 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | | 44 | 32 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2045 | | 15 | 11 | 0,01 |
| 0,492 % fällig am 25.01.2037 | | 8 | 6 | 0,01 |
| 2,905 % fällig am 25.09.2037 (b) | | 33 | 30 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,561 % fällig am 20.04.2035 | | 13 | 13 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | | 3 | 2 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,723 % fällig am 25.08.2035 | | 18 | 16 | 0,02 |
| **Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,865 % fällig am 25.10.2033 | | 8 | 8 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (b) | | 6 | 6 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.11.2032 | | 4 | 3 | 0,00 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 | | 3 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,691 % fällig am 25.12.2034 | | 14 | 13 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.05.2037 | | 8 | 5 | 0,00 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 | | 35 | 27 | 0,03 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,502 % fällig am 25.06.2037 | | 8 | 5 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,402 % fällig am 25.02.2037 (b) | | 25 | 22 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.10.2036 | | 6 | 3 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,738 % fällig am 25.07.2036 (b) | | $ 7 | $ 7 | 0,01 |
| | | | 281 | 0,27 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **Citigroup Global Marlets, Inc.** | | | | |
| 0,580 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024 bewertet mit $12.870. Die Rückkauferlöse betragen $12.601.) | | 12.600 | 12.600 | 11,98 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 0,560 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022 bewertet mit $4.652. Die Rückkauferlöse betragen $4.500.) | | 4.500 | 4.500 | 4,28 |
| | | | 17.100 | 16,26 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 1.800 | 1.795 | 1,71 |
| Summe USA | | | 23.381 | 22,24 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 449.459 | 4.496 | 4,27 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 104.319** | **99,21** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 18.600 | $ (46) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 1.700 | 14 | 0,01 |
| | | | | | $ (32) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (32)** | **(0,03)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,038 | 04.02.2016 | € 900 | $ 12 | $ 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,200 | 25.02.2016 | $ 1.200 | 19 | 25 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 500 | 22 | 27 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,000 | 28.03.2016 | 300 | 13 | 16 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,550 | 19.09.2016 | 750 | 20 | 29 | 0,03 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BPS | JPY 119,000 | 13.01.2016 | 4.900 | 27 | 10 | 0,01 |
| Put - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 2,810 | 02.02.2016 | 600 | 7 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 120 | $ 109 | 0,10 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

### VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | CBK | $ 1,143 | 04.02.2016 | € 900 | $ (11) | $ (1) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,130 | 09.02.2016 | 1.100 | (8) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 500 | (11) | (13) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,300 | 28.03.2016 | 300 | (6) | (8) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 7,000 | 19.09.2016 | 1.510 | (20) | (21) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | NGF | 7,000 | 31.10.2016 | 800 | (10) | (13) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 760 | (19) | (4) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | RUB 70,000 | 19.01.2016 | 300 | (4) | (14) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 74,000 | 09.03.2016 | 300 | (6) | (10) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus South African rand | DUB | ZAR 15,000 | 19.02.2016 | 300 | (4) | (15) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.210,000 | 15.02.2016 | 400 | (4) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus South Korean won | UAG | 1.210,000 | 16.02.2016 | 400 | (5) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Turkish lira | HUS | TRY 3,070 | 02.02.2016 | 600 | (7) | (2) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,697 | 25.02.2016 | 1.200 | (19) | (8) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 500 | (10) | (8) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,800 | 28.03.2016 | 300 | (6) | (5) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 6,370 | 19.09.2016 | 750 | (5) | (3) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Indian rupee | BOA | INR 68,530 | 16.03.2016 | 760 | (18) | (22) | (0,02) |
| | | | | | $ (173) | $ (153) | (0,14) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BRC | $ 1.000 | $ 0 | $ (3) | $ 3 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 200 | (2) | (2) | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 400 | (4) | (6) | 2 | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 100 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 1.000 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | JPM | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 500 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 200 | (7) | 0 | (7) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 700 | 0 | 4 | (4) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | HUS | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | HUS | 200 | (7) | (1) | (6) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 100 | (3) | 1 | (4) | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 150 | 1 | (4) | 5 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 50 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 200 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| Kazakhstan Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 100 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 300 | (1) | (4) | 3 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BPS | 200 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 500 | (2) | (8) | 6 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 600 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BRC | 600 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ (35) | $ (35) | $ 0 | (0,03) |

[1] Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | BPS | BRL 2.700 | $ (5) | $ (1) | $ (4) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | CBK | 6.000 | (11) | (1) | (10) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | JPM | 9.200 | (16) | (2) | (14) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2016 | BOA | 4.200 | (6) | 0 | (6) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | HUS | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,740 % | 03.10.2016 | BPS | 5.700 | (2) | (2) | 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 10,910 % | 02.01.2017 | MYC | 2.200 | (27) | 3 | (30) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,470 % | 02.01.2017 | BPS | 9.900 | (92) | (16) | (76) | (0,09) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | BPS | 5.900 | 35 | (3) | 38 | 0,03 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | DUB | BRL 5.900 | $ 35 | $ (7) | $ 42 | 0,03 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2017 | JPM | 12.900 | (58) | 0 | (58) | (0,06) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,820 % | 02.01.2017 | HUS | 14.400 | 61 | 0 | 61 | 0,06 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | GLM | 10.100 | (40) | (6) | (34) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | DUB | 3.600 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | HUS | 5.600 | (3) | 1 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | CBK | 2.000 | (35) | (7) | (28) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | UAG | 11.520 | (187) | (34) | (153) | (0,18) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | BPS | 3.400 | 55 | 21 | 34 | 0,05 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | HUS | 6.500 | 105 | 84 | 21 | 0,10 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,000 % | 02.01.2018 | DUB | 3.600 | 48 | 0 | 48 | 0,05 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,000 % | 02.01.2018 | JPM | 8.500 | 113 | 0 | 113 | 0,11 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,375 % | 02.01.2018 | HUS | 21.200 | (242) | 0 | (242) | (0,23) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | GLM | 4.100 | (41) | (1) | (40) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | HUS | 5.600 | (15) | 0 | (15) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | BPS | 4.500 | (150) | 0 | (150) | (0,14) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | BPS | 1.800 | (54) | (1) | (53) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 1.100 | (31) | (2) | (29) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | BPS | 2.100 | (44) | 4 | (48) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | DUB | 1.310 | (27) | 3 | (30) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | GLM | 2.000 | (42) | 5 | (47) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,310 % | 04.01.2021 | CBK | 2.500 | (51) | (41) | (10) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,310 % | 04.01.2021 | DUB | 2.400 | (49) | (36) | (13) | (0,05) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,315 % | 04.01.2021 | HUS | 12.600 | 256 | 0 | 256 | 0,24 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,320 % | 04.01.2021 | BPS | 800 | (16) | (12) | (4) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,345 % | 04.01.2021 | CBK | 600 | (12) | (9) | (3) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 5.500 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,285 % | 02.01.2025 | DUB | 1.900 | (66) | 0 | (66) | (0,06) |
| | | | | | | $ (606) | $ (60) | $ (546) | (0,58) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 608 | BRL | 2.374 | BOA | $ 0 | $ (8) | $ (8) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 2.374 | $ | 602 | BOA | 3 | (1) | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.320 | | 2.233 | BPS | 383 | 0 | 383 | 0,36 |
| 01/2016 | $ | 1.874 | BRL | 7.320 | BPS | 0 | (23) | (23) | (0,02) |
| 01/2016 | | 13.898 | | 52.481 | DUB | 0 | (633) | (633) | (0,60) |
| 01/2016 | BRL | 52.481 | $ | 14.264 | DUB | 999 | 0 | 999 | 0,95 |
| 01/2016 | $ | 299 | BRL | 1.162 | FBF | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.162 | $ | 297 | FBF | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 16.036 | | 5.370 | GLM | 1.317 | 0 | 1.317 | 1,25 |
| 01/2016 | $ | 4.108 | BRL | 16.036 | GLM | 0 | (54) | (54) | (0,05) |
| 01/2016 | BRL | 6.187 | $ | 1.585 | JPM | 21 | 0 | 21 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1.584 | BRL | 6.187 | JPM | 0 | (21) | (21) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 6.200 | $ | 1.588 | MSB | 21 | 0 | 21 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1.556 | BRL | 6.200 | MSB | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| 01/2016 | BRL | 10.720 | $ | 2.745 | UAG | 36 | 0 | 36 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 2.675 | BRL | 10.720 | UAG | 35 | 0 | 35 | 0,03 |
| 01/2016 | | 83 | CNH | 532 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.671 | CNY | 62.201 | BOA | 0 | (168) | (168) | (0,16) |
| 01/2016 | CNY | 3.163 | $ | 490 | BPS | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| 01/2016 | | 2.648 | | 406 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.570 | | 1.465 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7 | € | 7 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 387 | $ | 414 | BPS | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | | 878 | | 956 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.755 | | 4.002 | HUS | 0 | (77) | (77) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 265 | € | 242 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 50 | $ | 55 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | € | 3 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.274 | | 4.828 | UAG | 0 | (29) | (29) | (0,03) |
| 01/2016 | | 426 | INR | 28.184 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 34.238 | $ | 516 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 46.308 | | 691 | MSB | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 01/2016 | JPY | 13.400 | | 110 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 111 | JPY | 13.400 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 815.233 | $ | 692 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.147 | | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 133.226 | | 116 | DUB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 52.863 | | 45 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 384.880 | | 329 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.773 | KRW | 13.847.172 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 61.297 | $ | 52 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 190.336 | | 166 | RYL | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 268 | MYR | 1.154 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 773 | $ | 179 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.921 | MYR | 17.219 | SCX | 71 | 0 | 71 | 0,07 |
| 01/2016 | PEN | 5.132 | $ | 1.564 | BOA | 60 | 0 | 60 | 0,06 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 1.516 | PEN | 5.132 | FBF | $ 0 | $ (12) | $ (12) | (0,01) |
| 01/2016 | PHP | 9.412 | $ | 200 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.547 | PHP | 72.861 | GLM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 334 | $ | 7 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.954 | | 62 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.591 | RUB | 647.540 | BRC | 0 | (766) | (766) | (0,73) |
| 01/2016 | | 520 | | 34.187 | DUB | 0 | (54) | (54) | (0,05) |
| 01/2016 | | 226 | | 14.836 | FBF | 0 | (24) | (24) | (0,02) |
| 01/2016 | RUB | 3.397 | $ | 48 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 191 | RUB | 12.604 | GLM | 0 | (19) | (19) | (0,02) |
| 01/2016 | TRY | 275 | $ | 92 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.769 | TRY | 5.222 | SCX | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| 02/2016 | BRL | 7.320 | $ | 1.855 | BPS | 23 | 0 | 23 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 492 | BRL | 1.978 | BRC | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 1.390 | $ | 345 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.502 | BRL | 37.602 | DUB | 0 | (95) | (95) | (0,09) |
| 02/2016 | BRL | 44 | $ | 11 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 344 | BRL | 1.390 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 895.123 | $ | 284 | BPS | 5 | (2) | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 148 | COP | 474.340 | BRC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 3.600.023 | $ | 1.226 | HUS | 97 | 0 | 97 | 0,09 |
| 02/2016 | CZK | 223 | | 9 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.366 | | 176 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.173 | CZK | 54.607 | CBK | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| 02/2016 | CZK | 1.996 | $ | 81 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 246 | | 10 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.828 | | 5.277 | UAG | 29 | 0 | 29 | 0,03 |
| 02/2016 | £ | 400 | | 607 | JPM | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| 02/2016 | HKD | 160 | | 21 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 315.533 | | 22 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.104.240 | | 506 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.374.521 | | 514 | GLM | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| 02/2016 | | 249.790 | | 18 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.835 | IDR | 67.856.826 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 853 | ILS | 3.308 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 77 | $ | 20 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.245 | | 320 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.005 | INR | 67.927 | BRC | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| 02/2016 | | 10.658 | | 720.560 | CBK | 146 | 0 | 146 | 0,14 |
| 02/2016 | JPY | 840.000 | $ | 6.853 | BPS | 0 | (137) | (137) | (0,13) |
| 02/2016 | | 630.000 | | 5.138 | CBK | 0 | (104) | (104) | (0,10) |
| 02/2016 | | 13.400 | | 111 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 469 | | 332 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.508 | SGD | 12.002 | HUS | 0 | (63) | (63) | (0,06) |
| 02/2016 | SGD | 387 | $ | 273 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 535 | | 378 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.332 | THB | 119.609 | BOA | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| 02/2016 | THB | 507 | $ | 14 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 15.883 | | 438 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.452 | | 123 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 3.841 | | 116 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.589 | | 140 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.040 | | 92 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 494 | | 15 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.460 | TWD | 145.408 | JPM | 0 | (54) | (54) | (0,05) |
| 02/2016 | TWD | 7.439 | $ | 227 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.308 | | 251 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | HUF | 57.400 | | 200 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 03/2016 | | 38.695 | | 133 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 1.761 | | 102 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 10.192 | MXN | 174.764 | GLM | 0 | (124) | (124) | (0,12) |
| 03/2016 | MXN | 3.463 | $ | 200 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 2.220 | PEN | 7.450 | BRC | 0 | (59) | (59) | (0,06) |
| 03/2016 | | 136 | | 461 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | PEN | 182 | $ | 53 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | | 5.132 | | 1.498 | FBF | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| 03/2016 | | 123 | | 36 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 26 | PEN | 89 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 89 | | 305 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 113 | $ | 29 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.147 | | 291 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | RUB | 30.405 | | 423 | BPS | 16 | 0 | 16 | 0,02 |
| 03/2016 | $ | 980 | RUB | 73.147 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 134 | | 10.007 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 231 | $ | 15 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 174 | ZAR | 2.752 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | ZAR | 19.664 | $ | 1.241 | GLM | 1 | (12) | (11) | (0,01) |
| 03/2016 | | 274 | | 18 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 1.184 | ZAR | 18.079 | JPM | 0 | (33) | (33) | (0,03) |
| 03/2016 | ZAR | 2.205 | $ | 145 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 4.800 | | 1.343 | BPS | 166 | 0 | 166 | 0,16 |
| 04/2016 | | 1.700 | | 425 | DUB | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 04/2016 | $ | 324 | BRL | 1.300 | JPM | 0 | (6) | (6) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 04/2016 | BRL | 3.100 | $ | 936 | JPM | $ 176 | $ 0 | $ 176 | 0,17 |
| 04/2016 | $ | 1.659 | CLP | 1.179.807 | HUS | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| 04/2016 | CLP | 48.271 | $ | 67 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | | 5.760 | | 8 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | $ | 1.000 | CNY | 5.980 | DUB | 0 | (99) | (99) | (0,09) |
| 04/2016 | MXN | 21.378 | $ | 1.332 | DUB | 105 | 0 | 105 | 0,10 |
| 05/2016 | HUF | 51.622 | | 176 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 05/2016 | MXN | 38.431 | | 2.304 | GLM | 102 | 0 | 102 | 0,10 |
| 05/2016 | $ | 6.980 | PLN | 27.713 | DUB | 22 | 0 | 22 | 0,02 |
| 05/2016 | | 3.984 | ZAR | 59.806 | BOA | 0 | (217) | (217) | (0,21) |
| 07/2016 | BRL | 10.272 | $ | 2.600 | BPS | 156 | 0 | 156 | 0,15 |
| 07/2016 | CNH | 7.107 | | 1.060 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 07/2016 | $ | 1.060 | CNY | 7.113 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 532 | $ | 81 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 09/2016 | | 4.085 | | 620 | BRC | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| 09/2016 | | 2.439 | | 370 | HUS | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 09/2016 | | 5.288 | | 800 | JPM | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| 09/2016 | | 1.918 | | 290 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 10/2016 | $ | 173 | ARS | 3.079 | FBF | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 10/2016 | | 465 | BRL | 2.023 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 1.800 | $ | 424 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 10/2016 | | 3.674 | | 1.011 | DUB | 164 | 0 | 164 | 0,16 |
| 10/2016 | | 2.020 | | 465 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 10/2016 | | 9.100 | | 2.283 | JPM | 185 | 0 | 185 | 0,18 |
| 10/2016 | CNH | 527 | | 81 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 10/2016 | CZK | 11.062 | | 452 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 11/2016 | $ | 160 | ARS | 2.880 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 01/2017 | BRL | 6.500 | $ | 1.511 | BPS | 51 | 0 | 51 | 0,05 |
| 01/2017 | | 1.500 | | 356 | DUB | 19 | 0 | 19 | 0,02 |
| 01/2017 | CNH | 7.188 | | 1.060 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2017 | $ | 1.060 | CNY | 7.204 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 07/2017 | BRL | 4.000 | $ | 1.360 | BPS | 514 | 0 | 514 | 0,49 |
| 07/2017 | | 5.200 | | 1.763 | JPM | 663 | 0 | 663 | 0,63 |
| 07/2017 | | 14.600 | | 4.995 | UAG | 1.905 | 0 | 1.905 | 1,81 |
| | | | | | | $ 7.733 | $ (2.981) | $ 4.752 | 4,52 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 4.067** | **3,87** |
| **Summe Anlagen** | **$ 108.354** | **103,05** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 10 | $ 14 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | 12 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2.789 | 23 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 324 | 324 | 0,31 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 28 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 101 | 101 | 0,10 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 97 | 97 | 0,09 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 2 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 3 | 5 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.175 | 10 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 594** | **0,57** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (3.799)** | **(3,62)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 105.149** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Das Wertpapier ist in Verzug.

(c) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.150 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.

**(d) Barmittel in Höhe von USD 263 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(e) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 7.313 | $ 96.974 | $ 32 | $ 104.319 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 4.035 | 0 | 4.035 |
| **Summen** | **$ 7.313** | **$ 101.009** | **$ 32** | **$ 108.354** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 11.563 | $ 148.138 | $ 38 | $ 159.739 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 2.103 | 0 | 2.103 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (3.409) | 0 | (3.409) |
| **Summen** | **$ 11.563** | **$ 146.832** | **$ 38** | **$ 158.433** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(f) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (374) | $ 290 | $ (84) |
| BPS | 903 | (880) | 23 |
| BRC | (803) | 840 | 37 |
| CBK | (36) | 20 | (16) |
| DUB | 360 | (890) | (530) |
| FBF | 4 | 0 | 4 |
| GLM | 1.085 | (950) | 135 |
| GST | (4) | 0 | (4) |
| HUS | 101 | 0 | 101 |
| JPM | 1.008 | (1.120) | (112) |
| MSB | 32 | 0 | 32 |
| MYC | (58) | 0 | (58) |
| NGF | (13) | 0 | (13) |
| RYL | 4 | 0 | 4 |
| SCX | 85 | 0 | 85 |
| SOG | (11) | 0 | (11) |
| UAG | 1.784 | (1.730) | 54 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(g) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,21 | 97,24 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,03) | (0,02) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 3,87 | (2,05) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 1,28 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 9.047.649 | $ 90.535 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,009 % fällig am 06.07.2015 | JPY | 1.560.000 | 13.027 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,028)% fällig am 22.02.2016 | | 1.470.000 | 11.959 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,006)% fällig am 27.07.2015 | | 960.000 | 8.023 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 4.400 | 4.354 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 2,940 % fällig am 28.05.2015 | MXN | 520.000 | 3.447 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 33.000 | 3.338 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.07.2015 | $ | 3.200 | 3.200 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 10.900 | 2.645 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | | 9.600 | 2.636 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 3,460 % fällig am 26.05.2016 | MXN | 391.000 | 2.333 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2015 | $ | 2.000 | 2.000 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 6.200 | 1.986 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 24.09.2015 | MXN | 308.000 | 1.985 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 3,210 % fällig am 25.06.2015 | | 308.000 | 1.974 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.11.2020 | $ | 1.900 | 1.897 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 1.800 | 1.830 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 8.000 | 1.801 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 3,150 % fällig am 29.10.2015 | MXN | 260.000 | 1.665 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 3,080 % fällig am 10.09.2015 | | 250.000 | 1.595 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 9.753.788 | $ 97.600 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 4.400 | 4.377 |
| **Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.** | | | |
| 8,700 % fällig am 17.03.2016 | RUB | 214.000 | 3.422 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.07.2015 | $ | 3.200 | 3.200 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | | BRL 8.600 | 2.518 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.11.2020 | $ | 1.900 | 1.895 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 7,000 % fällig am 31.01.2016 | RUB | 109.000 | 1.657 |
| **Peru Government International Bond** | | | |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | PEN | 5.580 | 1.637 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 6.200 | 1.559 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2015 | | 4.400 | 1.509 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2015 | $ | 1.500 | 1.500 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 6.400 | 1.424 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | $ | 1.000 | 991 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.08.2015 | | 800 | 800 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 800 | 785 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2017 | BRL | 3.100 | 767 |
| **Samruk-Energy JSC** | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | $ | 600 | 586 |
| **Poland Government International Bond** | | | |
| 5,750 % fällig am 23.09.2022 | PLN | 1.600 | 538 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 19.08.2015 | $ | 500 | 500 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | |
| 1,047 % fällig am 12.06.2017 | | 500 | 499 |

(a) Der Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Virgin Media Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2023 | $ | 2.020 | € 1.823 | 0,17 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | | 1.300 | 1.188 | 0,11 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 2.500 | 2.301 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 100 | 95 | 0,01 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 1,114 % fällig am 05.11.2018 | | 7.300 | 6.725 | 0,62 |
| **Arkle Master Issuer PLC** | | | | |
| 3,986 % fällig am 17.08.2017 | £ | 500 | 718 | 0,07 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 24.10.2018 | € | 2.300 | 2.493 | 0,23 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2016 | | 1.900 | 1.958 | 0,18 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 4.000 | 3.921 | 0,36 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | | 900 | 123 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 1.000 | 137 | 0,01 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | | 2.300 | 2.315 | 0,21 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 3.600 | 3.393 | 0,31 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | $ | 2.500 | 2.299 | 0,21 |
| **Bank Nederlandse Gemeenten NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 26.08.2022 | € | 4.900 | 4.902 | 0,45 |
| 1,875 % fällig am 14.01.2021 | | 8.700 | 9.414 | 0,87 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 3.200 | 3.360 | 0,31 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 3.550 | 3.493 | 0,32 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 900 | 914 | 0,08 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.300 | 1.767 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 3.200 | 3.479 | 0,32 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.900 | 1.868 | 0,17 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 2.800 | 2.648 | 0,24 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,013 % fällig am 27.04.2018 | | 3.900 | 3.578 | 0,33 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 150 | 179 | 0,02 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 1.800 | 1.710 | 0,16 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 5.700 | 5.652 | 0,52 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 2.500 | 3.343 | 0,31 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | $ | 1.500 | 1.527 | 0,14 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 4.600 | 4.237 | 0,39 |
| **Credit Suisse Group Guernsey I Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | | 2.000 | 1.900 | 0,18 |
| **Criteria Caixa S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 21.04.2022 | € | 1.100 | 1.048 | 0,10 |
| **Depfa ACS Bank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | | 1.000 | 1.032 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2016 | $ | 500 | 467 | 0,04 |
| **Deutsche Börse AG** | | | | |
| 1,125 % fällig am 26.03.2018 | € | 300 | 306 | 0,03 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 18.09.2019 | | 250 | 261 | 0,02 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | $ | 900 | 830 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 800 | 746 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 800 | 768 | 0,07 |
| **Erste Europaische Pfandbrief- und Kommunalkreditbank AG in Luxemburg S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.06.2018 | € | 4.050 | 4.400 | 0,41 |
| 5,125 % fällig am 21.01.2016 | $ | 1.400 | € 1.291 | 0,12 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,476 % fällig am 23.04.2020 | | 2.800 | 2.584 | 0,24 |
| **Heta Asset Resolution AG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.05.2016 (c) | CHF | 300 | 183 | 0,02 |
| **HSC Holdings PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.950 | 2.977 | 0,27 |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | | 600 | 576 | 0,05 |
| **ICADE** | | | | |
| 2,250 % fällig am 30.01.2019 | | 200 | 208 | 0,02 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 22.699 | 20.583 | 1,90 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 4.800 | 4.421 | 0,41 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 4.100 | 3.894 | 0,36 |
| **KFW** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 200 | 150 | 0,01 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | | 700 | 495 | 0,05 |
| **LBG Capital No.1 PLC** | | | | |
| 2,975 % fällig am 12.03.2020 | € | 800 | 812 | 0,08 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 3.900 | 6.296 | 0,58 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 4.600 | 6.552 | 0,60 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | $ | 19 | 18 | 0,00 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 27.10.2022 | € | 8.300 | 8.278 | 0,76 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 165.000 | 22.213 | 2,05 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 10.700 | 1.422 | 0,13 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | € | 600 | 527 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 300 | 269 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 1.400 | 1.267 | 0,12 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 384.405 | 51.935 | 4,79 |
| 1,750 % fällig am 02.05.2018 | € | 200 | 207 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 20.079 | 2.599 | 0,24 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 20.700 | 2.750 | 0,25 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 19.500 | 2.613 | 0,24 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 13.400 | 1.788 | 0,17 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 12.157 | 1.616 | 0,15 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 4,700 % fällig am 03.07.2018 | $ | 500 | 478 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 2.000 | 1.997 | 0,18 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 400 | 365 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.100 | 1.520 | 0,14 |
| **Slovenska izvozna in razvojna banka dd** | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | € | 1.800 | 1.826 | 0,17 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | $ | 1.700 | 1.597 | 0,15 |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.10.2017 | AUD | 1.600 | 1.095 | 0,10 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 497 | 574 | 0,05 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | $ | 3.600 | 3.467 | 0,32 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 2.900 | 2.648 | 0,24 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 2.400 | 2.211 | 0,20 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 800 | 756 | 0,07 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 1.600 | 1.998 | 0,18 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | $ | 1.900 | 1.703 | 0,16 |
| | | | 262.254 | 24,17 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Banque PSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.02.2016 | € | 3.100 | € 3.117 | 0,29 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | $ | 4.300 | 3.949 | 0,36 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 2.500 | 2.330 | 0,21 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 1.600 | 1.629 | 0,15 |
| **Glencore Finance Dubai Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.11.2018 | € | 200 | 174 | 0,01 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | | 2.000 | 1.860 | 0,17 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | | 2.100 | 1.942 | 0,18 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 3.500 | 3.557 | 0,33 |
| **SABMiller Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.01.2042 | $ | 2.200 | 2.062 | 0,19 |
| **Siemens Financieringsmaatschappij NV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 12.03.2021 | € | 280 | 296 | 0,03 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2013 Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.10.2020 | | 200 | 210 | 0,02 |
| **Solvay S.A.** | | | | |
| 0,706 % fällig am 01.12.2017 | | 2.800 | 2.812 | 0,26 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 24.03.2023 | £ | 300 | 399 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 1.000 | 1.422 | 0,13 |
| **Thales S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 20.03.2018 | € | 200 | 206 | 0,02 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2025 | $ | 600 | 570 | 0,05 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 23.04.2021 | € | 3.400 | 3.374 | 0,31 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | $ | 2.300 | 2.084 | 0,19 |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 200 | 179 | 0,02 |
| | | | 32.172 | 2,96 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | | 100 | 135 | 0,01 |
| **Korea Gas Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.04.2019 | € | 100 | 106 | 0,01 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | $ | 1.400 | 918 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 2.400 | 1.961 | 0,18 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | | 1.054 | 992 | 0,09 |
| **Telecom Italia Finance S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 24.01.2033 | € | 1.250 | 1.634 | 0,15 |
| | | | 5.746 | 0,53 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 300.172 | 27,66 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dauphin, Pennsylvania, Pennsylvania Turnpike Commission Revenue Bonds, Series 2009** | | | | |
| 6,105 % fällig am 01.12.2039 | | 850 | 973 | 0,09 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,205 % fällig am 14.01.2016 | $ | 4.900 | 4.511 | 0,42 |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | | 38 | 33 | 0,00 |
| **Fannie Mae TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | | 15.000 | 13.800 | 1,27 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | 15.000 | 14.218 | 1,31 |
| | | | 32.562 | 3,00 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | | 36.761 | 32.177 | 2,97 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 39.865 | 35.062 | 3,23 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 6.519 | 5.815 | 0,54 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | | 11.861 | 12.425 | 1,14 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 2.300 | 2.057 | 0,19 |
| | | | 87.536 | 8,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,819 % fällig am 25.01.2036 (c) | $ | 73 | € 59 | 0,01 |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 0,760 % fällig am 25.11.2042 | £ | 587 | 720 | 0,07 |
| 1,754 % fällig am 24.04.2049 | | 3.698 | 4.967 | 0,46 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | $ | 1.641 | 1.485 | 0,14 |
| 0,743 % fällig am 20.11.2035 | | 1.091 | 817 | 0,08 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2035 (c) | | 3.661 | 2.582 | 0,24 |
| 1,257 % fällig am 25.12.2035 | | 16 | 12 | 0,00 |
| 4,381 % fällig am 25.06.2047 (c) | | 254 | 208 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 (c) | | 14 | 12 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2017 | | 16 | 15 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (c) | | 501 | 411 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (c) | | 642 | 494 | 0,05 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,154 % fällig am 25.09.2045 | | 87 | 78 | 0,01 |
| **Auburn Securities 9 PLC** | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | £ | 1.834 | 2.473 | 0,23 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2034 | $ | 1.132 | 1.024 | 0,09 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,320 % fällig am 25.08.2035 | | 8 | 7 | 0,00 |
| 2,617 % fällig am 25.07.2033 | | 35 | 32 | 0,00 |
| 2,660 % fällig am 25.10.2035 | | 214 | 195 | 0,02 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 2,919 % fällig am 25.08.2035 | | 1.163 | 1.059 | 0,10 |
| 2,930 % fällig am 25.07.2036 (c) | | 1.180 | 872 | 0,08 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.10.2034 | | 300 | 275 | 0,03 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | | 219 | 149 | 0,01 |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 24.033 | 2.557 | 0,24 |
| **Bluestone Securities PLC** | | | | |
| 0,778 % fällig am 09.06.2044 | £ | 1.111 | 1.425 | 0,13 |
| **Business Mortgage Finance 5 PLC** | | | | |
| 0,953 % fällig am 15.02.2039 | | 398 | 523 | 0,05 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 0,933 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 1.406 | 920 | 0,08 |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | | 3.543 | 2.332 | 0,21 |
| 1,133 % fällig am 01.08.2020 | | 1.275 | 839 | 0,08 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | $ | 190 | 150 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,623 % fällig am 25.03.2034 | | 7 | 6 | 0,00 |
| 2,740 % fällig am 25.11.2035 | | 366 | 323 | 0,03 |
| 3,641 % fällig am 25.08.2035 (c) | | 1.740 | 1.369 | 0,13 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,399 % fällig am 25.09.2035 (c) | | 3.096 | 2.471 | 0,23 |
| **Claris ABS Srl** | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | € | 7.749 | 7.636 | 0,70 |
| **Claris Finance Srl** | | | | |
| 0,159 % fällig am 20.06.2055 | | 613 | 607 | 0,06 |
| **Conseco Finance Securitizations Corp.** | | | | |
| 7,970 % fällig am 01.05.2032 | $ | 439 | 246 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | | 618 | 437 | 0,04 |
| 1,162 % fällig am 25.02.2035 | | 537 | 418 | 0,04 |
| 2,390 % fällig am 25.04.2035 | | 309 | 238 | 0,02 |
| **Darrowby No.2 PLC** | | | | |
| 2,271 % fällig am 20.02.2044 | £ | 854 | 1.169 | 0,11 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | | 3.112 | 4.081 | 0,38 |
| **DECO Charlemagne S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 27.04.2025 | € | 2.186 | 2.189 | 0,20 |
| **DECO HARP Ltd.** | | | | |
| 1,200 % fällig am 27.04.2027 | | 2.771 | 2.757 | 0,25 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | £ | 3.662 | 4.879 | 0,45 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.12.2044 | | 1.786 | 2.328 | 0,21 |
| **Eurosail-UK PLC** | | | | |
| 0,885 % fällig am 13.06.2045 | | 1.590 | 2.136 | 0,20 |
| **F-E Mortgages Srl** | | | | |
| 0,202 % fällig am 15.12.2043 | € | 379 | € 376 | 0,03 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,255 % fällig am 25.03.2035 | $ | 113 | 83 | 0,01 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | € | 1.945 | 1.964 | 0,18 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 1,374 % fällig am 18.11.2049 | £ | 798 | 1.084 | 0,10 |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | | 337 | 458 | 0,04 |
| **Granite Mortgages PLC** | | | | |
| 0,329 % fällig am 20.01.2044 | € | 5 | 5 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 499 | 433 | 0,04 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | € | 1.090 | 1.036 | 0,10 |
| **Grecale RMBS Srl** | | | | |
| 0,447 % fällig am 27.01.2061 | | 4.343 | 4.284 | 0,39 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036(c) | $ | 25 | 21 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 19.05.2033 | | 19 | 17 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 | | 1.520 | 1.149 | 0,11 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035(c) | | 240 | 187 | 0,02 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | |
| 0,088 % fällig am 20.11.2022 | € | 3.150 | 3.088 | 0,28 |
| **Leofric No. 1 PLC** | | | | |
| 2,270 % fällig am 26.05.2050 | £ | 589 | 805 | 0,07 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | | 3.403 | 4.450 | 0,41 |
| **Mars 2600 Srl** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | € | 2.626 | 2.649 | 0,24 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,713 % fällig am 15.12.2050 | £ | 3.115 | 4.104 | 0,38 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,832 % fällig am 25.02.2036 | $ | 100 | 84 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages No.8 PLC** | | | | |
| 0,311 % fällig am 16.04.2035 | € | 255 | 235 | 0,02 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.12.2033 | $ | 57 | 50 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.03.2047 | | 4.074 | 2.987 | 0,28 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2046 | | 498 | 196 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037(c) | | 171 | 133 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 3.579 | 2.984 | 0,27 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC** | | | | |
| 0,775 % fällig am 12.12.2036 | £ | 611 | 755 | 0,07 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | | 134 | 164 | 0,02 |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 2.314 | 2.868 | 0,26 |
| **Residential Mortgage Securities 28 PLC** | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 1.197 | 1.609 | 0,15 |
| **ResLoC UK PLC** | | | | |
| 0,032 % fällig am 15.12.2043 | € | 1.750 | 1.592 | 0,15 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,763 % fällig am 10.06.2043 | £ | 438 | 572 | 0,05 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.12.2036 | $ | 3.300 | 2.519 | 0,23 |
| **Storm BV** | | | | |
| 0,258 % fällig am 22.02.2053 | € | 8.500 | 8.513 | 0,78 |
| 0,399 % fällig am 22.03.2051 | | 1.100 | 1.110 | 0,10 |
| 0,797 % fällig am 22.04.2054 | | 3.600 | 3.643 | 0,34 |
| 1,147 % fällig am 22.10.2053 | | 161 | 161 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.06.2036 | $ | 349 | 269 | 0,02 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | | 21 | 19 | 0,00 |
| 1,102 % fällig am 19.12.2034 | | 318 | 285 | 0,03 |
| 1,102 % fällig am 19.02.2035 | | 301 | 268 | 0,02 |
| 1,594 % fällig am 25.02.2036(c) | | 784 | 616 | 0,06 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 4,432 % fällig am 25.05.2037(c) | | 3.188 | 2.603 | 0,24 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,768 % fällig am 25.07.2037(c) | | 137 | 108 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,668 % fällig am 25.03.2036(c) | $ | 209 | € 190 | 0,02 |
| 2,736 % fällig am 25.04.2036 | | 88 | 81 | 0,01 |
| | | | 120.798 | 11,13 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | € | 465 | 461 | 0,04 |
| **CELF Low Levered Partners PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 04.03.2024 | | 294 | 289 | 0,03 |
| **Chapel BV** | | | | |
| 0,577 % fällig am 17.11.2064 | | 71 | 67 | 0,01 |
| **Cordatus CLO I PLC** | | | | |
| 0,283 % fällig am 30.01.2024 | | 3.789 | 3.758 | 0,35 |
| **Highlander Euro CDO III BV** | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | | 1.534 | 1.501 | 0,14 |
| **IM Grupo Banco Popular FTPYME I FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2039 | | 2.037 | 2.020 | 0,19 |
| **Panther CDO V BV** | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | | 728 | 700 | 0,06 |
| **Penta CLO 1 S.A.** | | | | |
| 0,172 % fällig am 04.06.2024 | | 1.576 | 1.562 | 0,14 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,347 % fällig am 25.10.2039 | | 800 | 679 | 0,06 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | | 1.540 | 1.531 | 0,14 |
| 0,649 % fällig am 27.12.2032 | | 3.800 | 3.806 | 0,35 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 1.020 | 1.022 | 0,09 |
| | | | 17.396 | 1,60 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.03.2016 | CHF | 200 | 185 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 | € | 1.900 | 1.924 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 900 | 952 | 0,09 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 3.300 | 3.564 | 0,33 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.07.2023 | | 2.300 | 2.505 | 0,23 |
| 4,125 % fällig am 21.05.2024 | | 2.600 | 3.056 | 0,28 |
| 4,688 % fällig am 12.03.2020 | | 300 | 348 | 0,03 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | BRL | 49 | 9 | 0,00 |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 125.300 | 4.681 | 0,43 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,490 %) fällig am 12.02.2016 | | 74.000 | 2.739 | 0,25 |
| (0,118 %) fällig am 02.09.2016 | | 303.000 | 11.225 | 1,03 |
| **Erste Abwicklungsanstalt** | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.02.2017 | $ | 2.000 | 1.838 | 0,17 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2020 | | 100 | 96 | 0,01 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 1,375 % fällig am 04.03.2021 | € | 600 | 637 | 0,06 |
| **FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico** | | | | |
| 0,850 % fällig am 17.09.2019 | | 14.000 | 14.122 | 1,30 |
| **Finnvera OYJ** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | | 1.700 | 1.709 | 0,16 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.11.2016 (d) | | 651 | 654 | 0,06 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (a)(d)(e) | | 7.425 | 7.813 | 0,72 |
| 1,000 % fällig am 25.11.2025 (e) | | 1.500 | 1.502 | 0,14 |
| 1,750 % fällig am 25.11.2024 (d) | | 300 | 324 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 25.05.2030 | | 12.100 | 13.709 | 1,26 |
| 3,000 % fällig am 25.04.2022 (d)(e) | | 28.200 | 32.936 | 3,04 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (e) | | 16.040 | 20.397 | 1,88 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | | 3.000 | 4.486 | 0,41 |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| (0,182 %) fällig am 31.03.2016 (e) | | 2.966 | 2.970 | 0,27 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 250.000 | 1.846 | 0,17 |
| **Instituto de Credito Oficial** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2020 | € | 200 | 234 | 0,02 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.12.2025 | | 30.600 | 31.696 | 2,92 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,150 % fällig am 15.12.2021 | € | 9.800 | € 10.513 | 0,97 |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 (b) | | 13.500 | 16.026 | 1,48 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 | | 5.300 | 6.614 | 0,61 |
| 4,500 % fällig am 01.05.2023 | | 8.300 | 10.242 | 0,94 |
| 4,750 % fällig am 01.09.2044 | | 8.200 | 11.601 | 1,07 |
| 5,000 % fällig am 01.09.2040 | | 2.400 | 3.417 | 0,32 |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 300 | 386 | 0,04 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 10.000 | 83 | 0,01 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,050 %) fällig am 20.01.2016 | | 240.000 | 1.837 | 0,17 |
| (0,047 %) fällig am 14.03.2016 | | 9.070.000 | 69.411 | 6,40 |
| (0,025 %) fällig am 22.03.2016 | | 5.850.000 | 44.769 | 4,13 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 09.04.2021 | € | 200 | 208 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | | 600 | 503 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 14.07.2017 | | 50 | 53 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 11.06.2020 | MXN | 36.000 | 2.114 | 0,19 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | | 11.900 | 698 | 0,06 |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | PLN | 200 | 51 | 0,00 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 5.100 | 3.366 | 0,31 |
| 2,350 % fällig am 01.06.2025 | | 4.900 | 3.241 | 0,30 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,500 % fällig am 10.09.2021 | $ | 21.800 | 20.078 | 1,85 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.04.2019 | € | 700 | € 813 | 0,08 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 (e)(f) | | 3.500 | 5.505 | 0,51 |
| **Republik Korea** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2024 | | 4.700 | 5.044 | 0,46 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 23.03.2017 | | 1.002 | 1.047 | 0,10 |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 7.100 | 6.887 | 0,63 |
| 4,125 % fällig am 26.01.2020 | € | 500 | 575 | 0,05 |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 11.750 | 12.206 | 1,12 |
| 4,750 % fällig am 10.05.2018 | $ | 4.000 | 3.918 | 0,36 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 3.500 | 3.562 | 0,33 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 3.700 | 3.815 | 0,35 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 4.200 | 4.412 | 0,41 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 31.01.2020 (b) | € | 11.330 | 11.724 | 1,08 |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | | 5.750 | 5.720 | 0,53 |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 20.000 | 20.683 | 1,91 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 40.500 | 44.218 | 4,07 |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 11.650 | 13.684 | 1,26 |
| 4,200 % fällig am 31.01.2037 | | 4.500 | 5.535 | 0,51 |
| 4,650 % fällig am 30.07.2025 | | 7.300 | 9.184 | 0,85 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 (b) | | 9.175 | 13.034 | 1,20 |
| 5,400 % fällig am 31.01.2023 | | 1.700 | 2.177 | 0,20 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 100 | 158 | 0,01 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | € | 3.200 | € 3.625 | 0,33 |
| | | | 550.894 | 50,77 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.001.675 | 1.118 | 0,10 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | | 210.900 | 21.451 | 1,98 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Opusalpha Funding Ltd.** | | | | |
| 0,010 % fällig am 29.01.2016 | € | 5.000 | 5.000 | 0,46 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€ 1.139.723** | **105,03** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 50 | € (32) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 3 | (1) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 32 | (23) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 38 | (21) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 24 | 6 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 39 | (72) | (0,01) |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 2.072 | (697) | (0,06) |
| Euro-BONO Spanish Government Bond March Futures | Short | 03/2016 | 57 | 172 | 0,02 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 8 | 7 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 819 | (287) | (0,03) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 92 | (260) | (0,02) |
| Euro-OAT March Futures | Long | 03/2016 | 441 | (799) | (0,07) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 821 | 160 | 0,01 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 8 | 7 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 805 | (280) | (0,03) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.527 | (632) | (0,06) |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 1 | (1) | 0,00 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 5 | 3 | 0,00 |
| | | | | € (2.750) | (0,25) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | € 170,000 | 19.02.2016 | 697 | € 8 | € 7 | 0,00 |
| Call - Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | 112,300 | 19.02.2016 | 821 | 9 | 4 | 0,00 |
| Put - Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | 125,250 | 19.02.2016 | 1.553 | 9 | 8 | 0,00 |
| Put - Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | 125,500 | 19.02.2016 | 1.312 | 8 | 6 | 0,00 |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 108,000 | 19.02.2016 | 1.681 | 13 | 24 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 805 | 6 | 6 | 0,00 |
| | | | | € 53 | € 55 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ (2.695)** | **(0,25)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 4.158 | € (82) | (0,01) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 5.400 | (8) | 0,00 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 61.500 | (130) | (0,01) |
| iTraxx Europe Senior Financials Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 39.800 | (159) | (0,01) |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 54.500 | (197) | (0,02) |
| | | | | € (576) | (0,05) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,970 % | 13.02.2016 | £ 61.800 | € (295) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,950 % | 19.02.2016 | 56.600 | (261) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | $ 396.300 | 695 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | 13.100 | 45 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 45.200 | (13) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 31.08.2022 | 15.600 | (32) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,038 % | 31.08.2022 | 17.000 | 69 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 228.800 | (3.536) | (0,33) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 13.01.2023 | 14.900 | (232) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 120.500 | 378 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 16.12.2035 | 4.700 | (256) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.06.2026 | AUD 2.800 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 193.500 | 667 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,250 % | 18.09.2020 | 50.000 | 3.341 | 0,31 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 69.700 | 256 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 139.450 | (310) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 4.800 | (80) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 27.100 | 68 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.09.2018 | 16.100 | (155) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 10.100 | 87 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 900 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 3.600 | (110) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 22.03.2018 | JPY 20.630.000 | 69 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 % | 17.09.2021 | 2.730.000 | (191) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 18.12.2025 | 4.590.000 | (145) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,250 % | 17.06.2035 | 690.000 | 171 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2045 | 230.000 | 56 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,340 % | 28.09.2017 | MXN 153.700 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,195 % | 05.10.2017 | 118.800 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,130 % | 17.10.2017 | 364.400 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,260 % | 31.10.2017 | 260.300 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,610 % | 07.07.2021 | 360.600 | (126) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 11.10.2021 | 70.500 | (103) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,620 % | 09.11.2021 | 39.000 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 18.07.2022 | 37.000 | 11 | 0,00 |
| | | | | | € 48 | 0,00 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (528)** | **(0,05)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 1.400 | € 58 | € 68 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 8.000 | 319 | 391 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNY 6,520 | 31.10.2016 | 292 | 81 | 188 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 125,100 | 27.01.2016 | 6.300 | 40 | 2 | 0,00 |
| | | | | | € 498 | € 649 | 0,06 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Bond Fund (Forts.)

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | GST | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | € 25.400 | € 290 | € 316 | 0,03 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDS.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 5.300 | € (9) | € (4) | 0,00 |
| Put - CDS.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 9.400 | (16) | (7) | 0,00 |
| Put - CDS.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 2.800 | (6) | (2) | 0,00 |
| Call - CDS.IG-25 Index | GST | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 15.900 | (9) | 0 | 0,00 |
| Put - CDS.IG-25 Index | GST | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 15.900 | (28) | (23) | 0,00 |
| | | | | | | € (68) | € (36) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL | 4,300 | 28.03.2016 | $ 1.400 | € (27) | € (33) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | | 4,300 | 28.03.2016 | 8.000 | (150) | (190) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNY | 6,600 | 05.02.2016 | 3.600 | (36) | (21) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | | 6,600 | 05.02.2016 | 3.110 | (31) | (18) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | AZD | | 7,000 | 01.11.2016 | 2.000 | (21) | (29) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | | 7,000 | 01.11.2016 | 5.100 | (55) | (75) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | MSB | RUB | 70,000 | 02.02.2016 | 1.600 | (26) | (78) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | CBK | | 71,500 | 09.03.2016 | 1.300 | (26) | (64) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL | 3,800 | 28.03.2016 | 1.400 | (26) | (20) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | | 3,800 | 28.03.2016 | 8.000 | (157) | (113) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY | 117,350 | 27.01.2016 | 12.700 | (82) | (22) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW | 1.082,500 | 19.01.2016 | 2.900 | (19) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | GLM | | 1.092,500 | 20.01.2016 | 1.000 | (7) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | | 1.092,500 | 20.01.2016 | 3.100 | (21) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € (684) | € (663) | (0,06) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 0,400 % | 29.04.2016 | € 17.300 | € (57) | € 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 17.300 | (135) | (340) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GST | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,493 % | 01.09.2016 | 10.150 | (290) | (397) | (0,04) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 7.800 | (121) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 7.800 | (111) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 11.300 | (81) | (33) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 11.300 | (56) | (65) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 12.900 | (88) | (13) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 01.02.2016 | 12.900 | (80) | (10) | 0,00 |
| | | | | | | | € (1.019) | € (859) | (0,08) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[3] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | BPS | $ 500 | € (1) | € 0 | € (1) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | CBK | 3.100 | (4) | 1 | (5) | 0,00 |
| Wind Acquisition Finance S.A. | (5,000 %) | 20.06.2021 | BOA | € 3.800 | (165) | (478) | 313 | (0,01) |
| | | | | | € (170) | € (477) | € 307 | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[3] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| France Government Bond | 0,250 % | 20.12.2020 | GST | $ 34.550 | € 17 | € (49) | € 66 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2018 | BOA | 5.230 | 55 | (321) | 376 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 1.800 | 19 | (23) | 42 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 4.100 | 42 | (75) | 117 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 12.800 | 132 | (171) | 303 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | DUB | 3.900 | 37 | 5 | 32 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 3.400 | 35 | (47) | 82 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 2.400 | 25 | (32) | 57 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 10.000 | 103 | (232) | 335 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | € 100 | (9) | (8) | (1) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 700 | (39) | (7) | (32) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 600 | (52) | (45) | (7) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 200 | (11) | 0 | (11) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 2.100 | (181) | (159) | (22) | (0,02) |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[3] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | € 1.200 | € (103) | € (89) | € (14) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 200 | (17) | (15) | (2) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 1.100 | (1) | (8) | 7 | 0,00 |
| | | | | | € 52 | € (1.276) | € 1.328 | 0,01 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[3] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | BPS | € 1.400 | € 37 | € 28 | € 9 | 0,00 |

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

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

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BOA | € 32.400 | $ 35.543 | € 285 | € (98) | € 383 | 0,03 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | BOA | 3.750 | 4.065 | 58 | 10 | 48 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | BOA | 8.100 | 8.627 | 67 | (36) | 103 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.12.2020 | BPS | 13.100 | 14.200 | 161 | 15 | 146 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BPS | 12.011 | 13.176 | 134 | (8) | 142 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | CBK | 11.200 | 12.286 | 99 | (33) | 132 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | CBK | 26.150 | 28.347 | 624 | 292 | 332 | 0,06 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | DUB | 35.200 | 38.614 | 392 | (24) | 416 | 0,04 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | DUB | 4.800 | 5.093 | 58 | (3) | 61 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | GLM | 5.100 | 5.528 | 137 | 72 | 65 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month JPY-LIBOR abzgl. 0,908 % basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | MYC | $ 4.586 | PY 560.000 | (25) | (39) | 14 | 0,00 |
| | | | | | | € 1.990 | € 148 | € 1.842 | 0,18 |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Bond Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | BRL 100 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | GLM | 27.000 | 46 | 13 | 33 | 0,01 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | MYC | 7.400 | 13 | 6 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | € 59 | € 19 | € 40 | 0,01 |

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 16.08.2016 | DUB | CHF 27 | € 42 | € 0 | € 42 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,085 % | 16.08.2016 | DUB | 14 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,087 % | 16.08.2016 | DUB | 29 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,088 % | 16.08.2016 | DUB | 12 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,090 % | 16.08.2016 | DUB | 14 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 06.12.2016 | DUB | 8 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,103 % | 16.08.2016 | DUB | (14) | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,105 % | 16.08.2016 | DUB | (14) | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,106 % | 16.08.2016 | DUB | (27) | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,109 % | 16.08.2016 | DUB | (15) | (12) | 0 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,112 % | 16.08.2016 | DUB | (26) | (26) | 0 | (26) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,108 % | 06.12.2016 | DUB | (8) | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| | | | | | | € 131 | € 0 | € 131 | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 20.633 | € | 13.995 | CBK | € 176 | € 0 | € 176 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 10.737 | BRL | 41.924 | BOA | 0 | (129) | (129) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 41.924 | $ | 13.131 | BOA | 2.352 | (20) | 2.332 | 0,21 |
| 01/2016 | | 26.923 | | 6.822 | BPS | 46 | (30) | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.892 | BRL | 26.923 | BPS | 20 | (100) | (80) | (0,01) |
| 01/2016 | | 7.826 | | 30.288 | CBK | 39 | (196) | (157) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 30.288 | $ | 7.757 | CBK | 93 | 0 | 93 | 0,01 |
| 01/2016 | | 51.528 | | 13.310 | DUB | 336 | (73) | 263 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 13.189 | BRL | 51.528 | DUB | 33 | (185) | (152) | (0,01) |
| 01/2016 | | 4.468 | | 17.304 | FBF | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 17.304 | $ | 4.431 | FBF | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| 01/2016 | | 56.739 | | 14.531 | JPM | 174 | 0 | 174 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 14.713 | BRL | 56.739 | JPM | 302 | (643) | (341) | (0,03) |
| 01/2016 | | 1.587 | | 6.197 | UAG | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 6.197 | $ | 1.605 | UAG | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 9.927 | | 1.535 | BRC | 69 | (41) | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 856 | CNH | 5.456 | CBK | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 5.629 | € | 759 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 22.680 | DKK | 169.260 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 121.422 | € | 16.298 | MSB | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | | 62.632 | | 8.400 | UAG | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 6.813 | JPY | 900.600 | CBK | 78 | 0 | 78 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 11.900 | € | 90 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 888.700 | | 6.813 | UAG | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | IDR | 16.126.200 | $ | 1.156 | BOA | 6 | (12) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.058.100 | | 865 | BRC | 5 | (9) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.950 | | 1 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 21.126 | INR | 1.402.218 | BOA | 294 | (283) | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 485.985 | $ | 7.321 | JPM | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.621 | INR | 443.071 | JPM | 178 | (125) | 53 | 0,01 |
| 01/2016 | INR | 155.950 | $ | 2.343 | SCX | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 207.717 | | 3.127 | SOG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 2.660.000 | | 21.656 | BOA | 0 | (422) | (422) | (0,04) |
| 01/2016 | | 240.000 | | 1.973 | BPS | 9 | (30) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.660.000 | | 21.687 | JPM | 0 | (394) | (394) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 1.931 | KRW | 2.279.352 | BPS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | | 682 | | 790.779 | CBK | 14 | (23) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 3.440 | $ | 3 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.081.887 | | 942 | DUB | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.357.645 | | 6.334 | FBF | 190 | (120) | 70 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 250 | KRW | 283.118 | GLM | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.804 | | 3.260.316 | JPM | 21 | (50) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | | 775 | | 877.300 | JPM | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.897.461 | $ | 1.631 | JPM | 48 | (32) | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.365.571 | | 2.049 | SOG | 56 | (22) | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.610 | KRW | 1.848.306 | UAG | 41 | (76) | (35) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.947 | MYR | 12.171 | AZD | 48 | (164) | (116) | (0,01) |
| 01/2016 | MYR | 12.829 | $ | 2.966 | CBK | 49 | (56) | (7) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 765 | MYR | 3.212 | JPM | € 13 | € (32) | € (19) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 49.530 | $ | 11.279 | SCX | 376 | (563) | (187) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 3.266 | MYR | 13.981 | SOG | 13 | (36) | (23) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.808 | | 7.514 | UAG | 11 | (72) | (61) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 63.596 | $ | 943 | JPM | 95 | (25) | 70 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 899 | RUB | 63.596 | MSB | 5 | (34) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 10.387 | $ | 3.492 | JPM | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.138 | € | 778 | BPS | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 17.625 | $ | 4.466 | BPS | 66 | (14) | 52 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.227 | BRL | 4.857 | CBK | 21 | (32) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.411 | | 33.236 | DUB | 28 | (116) | (88) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.588 | | 6.197 | UAG | 8 | (43) | (35) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 15.704 | € | 10.994 | CBK | 596 | 0 | 596 | 0,06 |
| 02/2016 | CHF | 341 | | 317 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 74.155 | | 2.757 | UAG | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 61.415 | | 8.241 | GLM | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | | 13.455 | | 1.805 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.934 | $ | 2.057 | BPS | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.403 | £ | 1.022 | BPS | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 213.413 | € | 199.039 | CBK | 2.804 | (40) | 2.764 | 0,25 |
| 02/2016 | JPY | 900.600 | | 6.812 | CBK | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 10.147 | | 9.321 | DUB | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 3.855 | £ | 2.736 | FBF | 0 | (146) | (146) | (0,01) |
| 02/2016 | | 7.442 | $ | 7.907 | GLM | 0 | (170) | (170) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 56.466 | € | 79.492 | HUS | 2.944 | 0 | 2.944 | 0,27 |
| 02/2016 | $ | 4.289 | | 3.942 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 25.625 | | 2.753 | JPM | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.442 | £ | 3.153 | JPM | 0 | (167) | (167) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 60.987 | € | 56.227 | JPM | 222 | (84) | 138 | 0,01 |
| 02/2016 | NZD | 8.388 | | 5.238 | JPM | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.499 | JPY | 585.200 | JPM | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.587 | $ | 7.134 | JPM | 2 | (28) | (26) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 11.905 | € | 11.119 | MSB | 170 | 0 | 170 | 0,02 |
| 02/2016 | € | 2.561 | NZD | 4.160 | SCX | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 02/2016 | | 276 | £ | 200 | SOG | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | | 13.785 | $ | 15.100 | SOG | 103 | 0 | 103 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 134.772 | € | 124.356 | UAG | 509 | (102) | 407 | 0,04 |
| 02/2016 | € | 8.946 | $ | 9.492 | UAG | 0 | (216) | (216) | (0,02) |
| 02/2016 | IDR | 29.790.780 | | 2.084 | JPM | 33 | (67) | (34) | 0,00 |
| 02/2016 | | 16.297.115 | | 1.129 | SCX | 18 | (47) | (29) | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 199.804 | | 2.955 | BRC | 33 | (70) | (37) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 3.409 | | 2.407 | JPM | 24 | (16) | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.164 | | 2.958 | SCX | 86 | (61) | 25 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 92.140 | | 2.563 | FBF | 76 | (70) | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 47.941 | | 1.444 | BRC | 14 | (22) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | | 38.859 | | 1.174 | SOG | 12 | (15) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 88.365 | | 2.708 | UAG | 94 | (66) | 28 | 0,00 |
| 03/2016 | JPY | 1.600.000 | | 13.168 | BPS | 43 | (185) | (142) | (0,01) |
| 03/2016 | | 5.850.000 | | 48.471 | CBK | 148 | (383) | (235) | (0,02) |
| 03/2016 | | 2.150.000 | | 17.833 | HUS | 216 | (279) | (63) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 255 | MXN | 4.410 | BRC | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 67.984 | $ | 3.965 | GLM | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 451 | | 114 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 25.241 | | 7.415 | DUB | 1.129 | 0 | 1.129 | 0,10 |
| 04/2016 | | 32.743 | | 9.774 | GLM | 1.607 | 0 | 1.607 | 0,15 |
| 04/2016 | DKK | 169.260 | € | 22.690 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 63.596 | $ | 877 | MSB | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 20.925 | | 5.993 | CBK | 838 | 0 | 838 | 0,08 |
| 09/2016 | CNH | 3.111 | | 471 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 09/2016 | | 32.632 | | 4.937 | BPS | 93 | 0 | 93 | 0,01 |
| 09/2016 | | 9.205 | | 1.384 | BRC | 24 | (7) | 17 | 0,00 |
| 09/2016 | | 4.603 | | 692 | CBK | 12 | (3) | 9 | 0,00 |
| 09/2016 | | 4.601 | | 692 | HUS | 12 | (3) | 9 | 0,00 |
| 09/2016 | | 60.995 | | 9.228 | JPM | 173 | 0 | 173 | 0,02 |
| 09/2016 | $ | 2.823 | CNH | 18.409 | JPM | 31 | (115) | (84) | (0,01) |
| 09/2016 | | 16.927 | | 110.455 | UAG | 190 | (701) | (511) | (0,05) |
| 09/2016 | CNH | 18.434 | $ | 2.789 | UAG | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 09/2016 | CZK | 100.065 | € | 3.726 | HUS | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 09/2016 | | 202.344 | | 7.536 | SOG | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 10/2016 | | 127.617 | | 4.787 | JPM | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 156.975 | | 21.097 | HUS | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 10/2016 | | 230.858 | | 30.984 | UAG | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | € 18.078 | € (7.754) | € 10.324 | 0,95 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | **€** | **11.830** | **1,09** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae TBA (h)** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (12.000) | € | (11.690) | (1,08) |
| 4,500 % fällig am 01.01.2046 | | (17.450) | | (17.349) | (1,60) |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | | (35.250) | | (34.994) | (3,22) |
| | | | € | (64.033) | (5,90) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **€** | **(64.033)** | **(5,90)** |
| **Summe Anlagen** | | | **€** | **1.084.297** | **99,92** |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 445 | € | 604 | 0,05 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 84 | | 77 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 15 | | 10 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 1 | | 1 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 26.609 | | 204 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.334 | | 2.148 | 0,20 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 1.763 | | 193 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 263 | | 2 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 3 | | 2 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 25 | | 23 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 24 | | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 728 | | 670 | 0,06 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 4 | | 3 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | | 1 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 111 | | 7 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 701 | | 645 | 0,06 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 9 | | 6 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 100 | | 66 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1.015 | | 1.015 | 0,09 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 11.207 | | 86 | 0,01 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 140 | | 191 | 0,02 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 17 | | 15 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€** | **5.976** | **0,55** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€** | **(5.064)** | **(0,47)** |
| **Nettovermögen** | | | **€** | **1.085.209** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 47.803 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(d) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 3.862 und Barmittel in Höhe von EUR 2.113 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 9.568 und Barmittel von EUR 5.967 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 640 und Barmittel in Höhe von EUR 216 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(g) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(h) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(i) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 22.569 | € 1.117.005 | € 149 | € 1.139.723 |
| Finanzderivate[3] | (2.695) | 11.302 | 0 | 8.607 |
| Leerverkäufe | 0 | (64.033) | 0 | (64.033) |
| **Summen** | **€ 19.874** | **€ 1.064.274** | **€ 149** | **€ 1.084.297** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 67.288 | € 999.742 | € 156 | € 1.067.186 |
| Finanzderivate[3] | (1.149) | (966) | 0 | (2.115) |
| **Summen** | **€ 66.139** | **€ 998.776** | **€ 156** | **€ 1.065.071** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 7.442 | CHF 8.102 | BPS | € 9 | € 0 | € 9 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 463 | € 426 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 7.444 | CHF 8.102 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 8.185 | € 7.576 | CBK | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| 01/2016 | € 7.707 | CHF 8.397 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 8.185 | € 7.575 | JPM | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | 8.204 | 7.593 | MSB | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | € 7.478 | CHF 8.141 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | 15 | 16 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 8.185 | € 7.575 | SCX | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 02/2016 | € 7.581 | CHF 8.185 | CBK | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| 02/2016 | 7.579 | 8.185 | JPM | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| 02/2016 | 7.579 | 8.185 | MSB | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| 02/2016 | 7.580 | 8.185 | SCX | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| | | | | € 233 | € (194) | € 39 | 0,00 |

**(k) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,250 % | 24.12.2015 | 05.01.2016 | $ 15.129 | € (13.931) | (1,28) |
| MYI | (0,080 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | € 11.806 | (11.804) | (1,09) |
| MYI | (0,050 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 22.385 | (22.383) | (2,06) |
| | | | | | € (48.118) | (4,43) |

**(l) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | € (145) | € 0 | € (145) |
| BOA | 2.090 | (2.175) | (85) |
| BPS | 224 | (190) | 34 |
| BRC | (441) | 384 | (57) |
| CBK | 4.640 | (5.290) | (650) |
| DUB | 1.926 | (2.709) | (783) |
| FBF | (16) | 0 | (16) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| GLM | € 1.645 | € (1.410) | € 235 |
| GST | (244) | 216 | (28) |
| HUS | 2.934 | (2.990) | (56) |
| JPM | (716) | 256 | (460) |
| MSB | 126 | (270) | (144) |
| MYC | 74 | 0 | 74 |
| SCX | 42 | 0 | 42 |
| SOG | 47 | 0 | 47 |
| UAG | (317) | (149) | (466) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(m) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 105,03 | 100,52 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,25) | (0,11) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,05) | 0,76 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,09 | (0,85) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (5,90) | 0,00 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 64.000 | € 76.555 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 62.100 | 67.967 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,047)% fällig am 14.03.2016 | JPY | 9.070.000 | 67.961 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 41.900 | 52.661 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | | 42.150 | 52.240 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 384.405 | 52.023 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,025)% fällig am 22.03.2016 | JPY | 5.850.000 | 44.009 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 45.246 | 41.280 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | € | 34.500 | 37.621 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.12.2025 | | 30.600 | 31.386 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 227.000 | 30.965 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | € | 31.150 | 30.813 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 29.700 | 30.553 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 19.075 | 27.520 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | | 26.000 | 26.494 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2015 | | 25.400 | 25.865 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,400 % fällig am 31.01.2020 | | 25.100 | 25.805 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | | 24.500 | 24.494 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 225.600 | 22.945 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 165.000 | 22.601 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | € | 20.550 | 20.363 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| (0,182)% fällig am 31.03.2016 | | 18.100 | 18.125 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 62.300 | € 76.488 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 676.400 | 68.765 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 44.950 | 55.940 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 41.900 | 53.562 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,400 % fällig am 31.01.2020 | | 50.200 | 51.494 |
| **France Government Bond** | | | |
| 2,250 % fällig am 25.05.2024 | | 41.500 | 47.670 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 33.200 | 47.328 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | | 34.500 | 37.814 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.05.2021 | | 28.100 | 32.468 |
| **France Government Bond** | | | |
| 1,750 % fällig am 25.11.2024 | | 24.700 | 27.556 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | | 26.000 | 26.350 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2015 | | 25.400 | 25.740 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | | 25.400 | 25.686 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | | 24.500 | 24.496 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 21.600 | 24.148 |
| **Poland Government International Bond** | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 95.500 | 24.112 |
| **France Government Bond** | | | |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | € | 18.260 | 23.871 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2028 | | 17.200 | 22.502 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 5,850 % fällig am 31.01.2022 | | 14.600 | 19.444 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 17.450 | 17.921 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.11.2022 | | 12.500 | 16.264 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 4,000 % fällig am 30.07.2015 | | 15.450 | 15.634 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2016 | | 15.000 | 15.470 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| (0,002)% fällig am 11.03.2016 | | 15.450 | 15.450 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,009 % fällig am 19.02.2016 | | 15.450 | 15.448 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2044 | | 10.600 | 15.313 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| (0,182)% fällig am 31.03.2016 | | 15.134 | 15.153 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 11.100 | 14.187 |

(a) Der Euro Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Credit Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | $ | 1.138 | € 1.029 | 0,23 |
| 3,000 % fällig am 04.01.2021 | | 1.584 | 1.433 | 0,33 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 1.688 | 1.544 | 0,35 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 1.606 | 1.475 | 0,33 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 2.126 | 1.948 | 0,44 |
| **Endo Luxembourg Finance I Co. Sarl** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.09.2022 | | 1.100 | 1.001 | 0,23 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 3,424 % fällig am 27.02.2021 | | 590 | 538 | 0,12 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 1.386 | 1.276 | 0,29 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 930 | 855 | 0,19 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 1.386 | 1.246 | 0,28 |
| | | | 12.345 | 2,79 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | | 1.300 | 1.195 | 0,27 |
| 6,250 % fällig am 13.09.2022 | | 1.000 | 968 | 0,22 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.02.2018 | | 2.100 | 1.928 | 0,44 |
| **alstria office REIT-AG** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.03.2021 | € | 1.000 | 998 | 0,23 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.02.2024 | $ | 100 | 95 | 0,02 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 400 | 360 | 0,08 |
| **Aon PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.06.2024 | | 2.700 | 2.430 | 0,55 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | € | 2.900 | 3.087 | 0,70 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | | 400 | 402 | 0,09 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 (a) | | 600 | 87 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | | 100 | 14 | 0,00 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.07.2020 | | 100 | 100 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 100 | 103 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 11.01.2018 | $ | 2.900 | 2.667 | 0,60 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 3.800 | 3.749 | 0,85 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 2.900 | 2.947 | 0,67 |
| 7,625 % fällig am 01.06.2019 | | 400 | 427 | 0,10 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 16.08.2019 | £ | 1.200 | 1.828 | 0,41 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.05.2024 | $ | 1.000 | 939 | 0,21 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 1.400 | 2.454 | 0,55 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.04.2022 | € | 6.400 | 6.347 | 1,43 |
| **BioMed Realty LP** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.05.2019 | $ | 200 | 179 | 0,04 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.01.2026 | € | 900 | 892 | 0,20 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 1.800 | 1.850 | 0,42 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | $ | 3.200 | 2.871 | 0,65 |
| **Brown & Brown, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2024 | | 900 | 820 | 0,18 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | | 2.800 | 2.642 | 0,60 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 2.000 | 1.906 | 0,43 |
| **Citycon Treasury BV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.09.2022 | € | 2.200 | 2.216 | 0,50 |
| **Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.07.2039 | € | 3.100 | € 3.668 | 0,83 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.06.2045 | | 2.300 | 2.273 | 0,51 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 0,264 % fällig am 18.11.2016 | | 900 | 902 | 0,20 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 3.200 | 3.816 | 0,86 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 1.300 | 1.235 | 0,28 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.03.2027 | € | 1.400 | 1.339 | 0,30 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 | | 4.100 | 4.476 | 1,01 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.04.2022 | | 8.100 | 7.857 | 1,78 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | $ | 968 | 912 | 0,21 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 3.750 | 3.457 | 0,78 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 2.500 | 2.332 | 0,53 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 1.825 | 1.751 | 0,40 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 27.07.2023 | € | 1.800 | 1.829 | 0,41 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2024 | | 1.100 | 1.117 | 0,25 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | $ | 6.500 | 6.117 | 1,38 |
| **Hammerson PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2022 | € | 300 | 306 | 0,07 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2025 | | 800 | 814 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 14.01.2022 | $ | 800 | 808 | 0,18 |
| **Inmobiliaria Colonial S.A.** | | | | |
| 2,728 % fällig am 05.06.2023 | € | 2.600 | 2.579 | 0,58 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2018 | $ | 150 | 139 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 50 | 47 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 3.800 | 3.844 | 0,87 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 1.500 | 1.474 | 0,33 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,928 % fällig am 15.09.2026 | € | 4.000 | 4.116 | 0,93 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.09.2022 | $ | 400 | 371 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 24.01.2022 | | 10.000 | 9.937 | 2,25 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 5.000 | 5.029 | 1,14 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2018 | | 3.200 | 2.903 | 0,66 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.09.2021 | € | 5.700 | 5.777 | 1,31 |
| 2,000 % fällig am 14.04.2020 | $ | 1.500 | 1.353 | 0,31 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,650 % fällig am 27.01.2020 | | 1.700 | 1.562 | 0,35 |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 2.600 | 2.470 | 0,56 |
| 4,750 % fällig am 22.03.2017 | | 1.700 | 1.621 | 0,37 |
| 5,625 % fällig am 23.09.2019 | | 200 | 203 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 28.08.2017 | | 1.000 | 986 | 0,22 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2018 | | 900 | 909 | 0,21 |
| 7,300 % fällig am 13.05.2019 | | 1.900 | 2.011 | 0,45 |
| **Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen** | | | | |
| 6,000 % fällig am 26.05.2041 | € | 400 | 473 | 0,11 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.02.2020 | $ | 4.400 | 4.635 | 1,05 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 800 | 690 | 0,16 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 350 | 340 | 0,08 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 4.800 | 616 | 0,14 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 (a) | € | 1.000 | 879 | 0,20 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 3.400 | 452 | 0,10 |
| **Prologis International Funding II S.A.** | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | € | 2.500 | 2.328 | 0,53 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 2.800 | 374 | 0,08 |
| **Reliance Standard Life Global Funding II** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.04.2019 | $ | 300 | 275 | 0,06 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 4.650 | € 4.644 | 1,05 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 400 | 365 | 0,08 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.02.2026 | € | 3.900 | 4.171 | 0,94 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | $ | 4.300 | 4.141 | 0,94 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 2.100 | 1.935 | 0,44 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 27.10.2022 | € | 700 | 705 | 0,16 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 5.500 | 5.114 | 1,16 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 17.09.2019 | | 800 | 731 | 0,16 |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | | 1.200 | 1.100 | 0,25 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 4.700 | 4.667 | 1,05 |
| 3,500 % fällig am 08.03.2022 | $ | 2.200 | 2.088 | 0,47 |
| | | | 179.564 | 40,58 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 3,781 % fällig am 31.07.2019 | £ | 500 | 687 | 0,16 |
| 4,720 % fällig am 31.07.2018 | | 2.300 | 3.246 | 0,73 |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.04.2020 | € | 1.900 | 1.786 | 0,40 |
| **Ahold Finance USA LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 14.03.2017 | £ | 3.100 | 4.448 | 1,01 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.09.2016 | $ | 800 | 743 | 0,17 |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.11.2020 | € | 3.200 | 3.204 | 0,72 |
| 5,000 % fällig am 02.10.2017 | £ | 1.200 | 1.728 | 0,39 |
| **Cellnex Telecom SAU** | | | | |
| 3,125 % fällig am 27.07.2022 | € | 2.000 | 1.920 | 0,43 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.07.2022 | $ | 500 | 468 | 0,11 |
| **CRH Funding BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2024 | € | 200 | 201 | 0,05 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | | 2.100 | 2.154 | 0,49 |
| **Delphi Automotive PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 10.03.2025 | | 4.900 | 4.539 | 1,03 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 01.08.2019 | $ | 2.400 | 2.186 | 0,49 |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 1.900 | 1.631 | 0,37 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 0,848 % fällig am 17.09.2019 | € | 2.500 | 2.487 | 0,56 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.10.2018 | $ | 200 | 185 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 15.10.2020 | | 900 | 840 | 0,19 |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | | 100 | 94 | 0,02 |
| **Finmeccanica SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 700 | 1.111 | 0,25 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | $ | 4.600 | 4.224 | 0,95 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 14.11.2017 | | 300 | 236 | 0,05 |
| **GFK SE** | | | | |
| 5,000 % fällig am 14.04.2016 | € | 500 | 506 | 0,11 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | |
| 1,681 % fällig am 15.01.2019 | $ | 350 | 267 | 0,06 |
| 1,700 % fällig am 27.05.2016 | | 3.300 | 3.023 | 0,68 |
| **Goldcorp, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 09.06.2021 | | 300 | 260 | 0,06 |
| 3,700 % fällig am 15.03.2023 | | 1.400 | 1.178 | 0,27 |
| **Hochtief AG** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.03.2020 | € | 1.400 | 1.507 | 0,34 |
| **Hutchison Whampoa Finance 09 Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.11.2016 | | 700 | 728 | 0,16 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 21.07.2022 | $ | 4.000 | 3.702 | 0,84 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2016 | £ | 1.539 | 2.179 | 0,49 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ITV PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.09.2022 | € | 2.400 | € 2.415 | 0,55 |
| **Kemira OYJ** | | | | |
| 2,500 % fällig am 27.05.2019 | | 800 | 826 | 0,19 |
| **Laboratory Corporation of America Holdings** | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.02.2022 | $ | 100 | 90 | 0,02 |
| **Merck Financial Services GmbH** | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.09.2022 | € | 3.000 | 3.062 | 0,69 |
| **Microsoft Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 03.11.2022 | $ | 600 | 552 | 0,12 |
| **Molnlycke Holding AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.02.2024 | € | 1.400 | 1.389 | 0,31 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | 508 | 0,12 |
| **OMV AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | | 500 | 487 | 0,11 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 08.07.2024 | $ | 1.500 | 1.404 | 0,32 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 12.08.2023 | | 300 | 323 | 0,07 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 2.245 | 2.197 | 0,50 |
| **Poste Italiane SpA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 18.06.2018 | € | 200 | 213 | 0,05 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 2.100 | 2.172 | 0,49 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.10.2025 | $ | 200 | 181 | 0,04 |
| **Safeway Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.12.2018 | £ | 2.700 | 3.995 | 0,90 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 1.400 | 1.365 | 0,31 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | | 400 | 405 | 0,09 |
| **Sky PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.09.2024 | $ | 3.000 | 2.702 | 0,61 |
| **Societa Esercizi Aereoportuali SpA Sea** | | | | |
| 3,125 % fällig am 17.04.2021 | € | 2.400 | 2.432 | 0,55 |
| **Solvay S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.12.2022 | | 200 | 200 | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 02.12.2027 | | 400 | 404 | 0,09 |
| **Stonegate Pub Co. Financing PLC** | | | | |
| 5,329 % fällig am 15.04.2019 | £ | 1.600 | 2.176 | 0,49 |
| **TDF Infrastructure SAS** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | € | 2.300 | 2.362 | 0,53 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 1,243 % fällig am 23.06.2017 | $ | 700 | 641 | 0,15 |
| 5,289 % fällig am 09.12.2022 | £ | 1.300 | 1.949 | 0,44 |
| 5,597 % fällig am 12.03.2020 | | 300 | 449 | 0,10 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 21.07.2022 | € | 4.500 | 4.654 | 1,05 |
| **Thomson Reuters Corp.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 29.09.2024 | $ | 500 | 452 | 0,10 |
| **Time Warner, Inc.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.09.2023 | € | 2.000 | 2.032 | 0,46 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2024 | $ | 400 | 379 | 0,09 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 10.12.2016 | € | 3.481 | 3.650 | 0,83 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | £ | 1.796 | 2.550 | 0,58 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2023 | $ | 600 | 542 | 0,12 |
| 2,875 % fällig am 15.03.2023 | | 300 | 274 | 0,06 |
| **Viacom, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2023 | | 2.500 | 2.105 | 0,48 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2021 | | 1.700 | 1.541 | 0,35 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 500 | 453 | 0,10 |
| | | | 104.999 | 23,73 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 2.700 | 2.393 | 0,54 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | $ | 400 | € 383 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | € | 1.750 | 1.894 | 0,43 |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | $ | 2.300 | 2.239 | 0,51 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 3,062 % fällig am 17.03.2022 | | 1.200 | 1.083 | 0,24 |
| **EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG** | | | | |
| 7,375 % fällig am 02.04.2072 | € | 2.800 | 2.974 | 0,67 |
| **Eurogrid GmbH** | | | | |
| 1,625 % fällig am 03.11.2023 | | 400 | 402 | 0,09 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.10.2018 | $ | 300 | 280 | 0,06 |
| **Laclede Group, Inc.** | | | | |
| 1,112 % fällig am 15.08.2017 | | 2.200 | 2.016 | 0,45 |
| **Madrilena Red de Gas Finance BV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | € | 400 | 474 | 0,11 |
| **Redexis Gas Finance BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2027 | | 600 | 522 | 0,12 |
| **RWE Finance BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 2.100 | 3.231 | 0,73 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | $ | 500 | 426 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 300 | 244 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 700 | 548 | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 161 | 0,04 |
| **Shell International Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 11.05.2025 | | 800 | 720 | 0,16 |
| **SPP-Distribucia** | | | | |
| 2,625 % fällig am 23.06.2021 | € | 2.200 | 2.291 | 0,52 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | | 1.400 | 1.487 | 0,34 |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | $ | 1.100 | 1.057 | 0,24 |
| **Total S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.12.2049 | € | 800 | 709 | 0,16 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2020 | $ | 700 | 693 | 0,16 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | | 7.800 | 7.906 | 1,79 |
| | | | 34.133 | 7,72 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 318.696 | 72,03 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,190 % fällig am 14.01.2016 (b) | | 1.050 | 967 | 0,22 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,792 % fällig am 25.10.2035 | | 910 | 828 | 0,19 |
| **Banc of America Funding Ltd.** | | | | |
| 0,503 % fällig am 03.10.2039 | | 2.084 | 1.888 | 0,43 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 0,475 % fällig am 26.07.2035 | | 67 | 61 | 0,01 |
| 0,740 % fällig am 26.11.2035 | | 210 | 190 | 0,04 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | | 294 | 272 | 0,06 |
| **Bluestone Securities PLC** | | | | |
| 0,798 % fällig am 09.06.2043 | £ | 270 | 340 | 0,08 |
| **COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,766 % fällig am 15.05.2046 | $ | 388 | 374 | 0,08 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,729 % fällig am 25.08.2034 (c) | | 147 | 126 | 0,03 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.06.2044 | £ | 193 | 254 | 0,06 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 2.593 | 2.251 | 0,51 |
| **Infinity Classico** | | | | |
| 0,109 % fällig am 15.02.2024 | € | 4.351 | 4.282 | 0,97 |
| **Landmark Mortgage Securities No. 3 PLC** | | | | |
| 0,859 % fällig am 17.04.2044 | £ | 1.854 | 2.279 | 0,51 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,217 % fällig am 25.02.2035 | $ | 626 | 574 | 0,13 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 401 | 372 | 0,08 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC** | | | | |
| 0,945 % fällig am 12.06.2043 | £ | 335 | € 421 | 0,09 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | | 187 | 231 | 0,05 |
| **Residential Mortgage Securities 25 PLC** | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | | 180 | 249 | 0,06 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.03.2044 | | 231 | 300 | 0,07 |
| 0,763 % fällig am 10.06.2043 | | 201 | 263 | 0,06 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 19.12.2034 | $ | 323 | 289 | 0,07 |
| | | | 15.844 | 3,58 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | € | 341 | 338 | 0,08 |
| **Cavalry CLO V Ltd.** | | | | |
| 1,687 % fällig am 16.01.2024 | $ | 10.000 | 9.177 | 2,07 |
| **CELF Low Levered Partners PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 04.03.2024 | € | 1.078 | 1.061 | 0,24 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,512 % fällig am 14.08.2024 | $ | 6.000 | 5.526 | 1,25 |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | | 476 | 438 | 0,10 |
| **Flagship CLO V** | | | | |
| 0,800 % fällig am 20.09.2019 | | 146 | 134 | 0,03 |
| **Gallatin CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,591 % fällig am 15.07.2023 | | 5.676 | 5.193 | 1,17 |
| **Jubilee CDO I-R BV** | | | | |
| 0,258 % fällig am 30.07.2024 | € | 226 | 223 | 0,05 |
| **LCM X LP** | | | | |
| 1,581 % fällig am 15.04.2022 | $ | 3.976 | 3.654 | 0,83 |
| **Madison Park Funding VIII Ltd.** | | | | |
| 1,570 % fällig am 22.04.2022 | | 2.218 | 2.042 | 0,46 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 1,470 % fällig am 25.07.2023 | | 6.000 | 5.509 | 1,24 |
| **Octagon Investment Partners XII Ltd.** | | | | |
| 1,604 % fällig am 05.05.2023 | | 7.151 | 6.578 | 1,49 |
| **RMF Euro CDO IV PLC** | | | | |
| 0,278 % fällig am 11.09.2022 | € | 13 | 13 | 0,00 |
| **SpringCastle America Funding LLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.05.2023 | $ | 1.677 | 1.541 | 0,35 |
| **Springleaf Funding Trust** | | | | |
| 3,920 % fällig am 16.01.2023 | | 1.000 | 921 | 0,21 |
| **Symphony CLO IX LP** | | | | |
| 1,617 % fällig am 16.04.2022 | | 1.978 | 1.813 | 0,41 |
| | | | 44.161 | 9,98 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | € | 700 | 741 | 0,17 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 900 | 972 | 0,22 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | $ | 900 | 822 | 0,18 |
| 3,625 % fällig am 21.01.2019 | € | 3.500 | 3.137 | 0,71 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 (a) | | 4.800 | 5.698 | 1,29 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 (a) | | 5.000 | 5.459 | 1,23 |
| | | | 16.829 | 3,80 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS (d)** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF** | | 175.700 | 17.870 | 4,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| (0,320 %) fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert vom Land Hessen 0,875 % fällig am 10.12.2024 bewertet mit €7.836. Die Rückkauferlöse betragen €8.000.) | € | 8.000 | € | 8.000 | 1,81 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€** | **434.712** | **98,25** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 736 | € (342) | (0,08) |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 450 | (1.008) | (0,23) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 199 | 0 | 0,00 |
| | | | | € (1.350) | (0,31) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (1.350)** | **(0,31)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 30.300 | € (41) | (0,01) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 61.700 | € (183) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2019 | 6.800 | (77) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 26.300 | (125) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 15.06.2021 | 5.800 | 24 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 29.900 | (437) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 19.000 | 59 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 25.100 | 86 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,200 % | 18.06.2018 | 39.100 | 268 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 9.900 | 97 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 18.03.2022 | 12.900 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 6.100 | 33 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | £ 7.100 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 2.600 | (5) | 0,00 |
| | | | | | € (246) | (0,05) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (287)** | **(0,06)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - iTraxx Europe Series 24 Index | BRC | Verkauf | 1,050 % | 20.01.2016 | € 4.400 | € (9) | € 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | $ 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 1.500 | (2) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 4.600 | (9) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 1.500 | (3) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | € (24) | € (6) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | € 400 | € 6 | € (5) | € 11 | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 900 | 0 | 6 | (6) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 600 | 0 | 5 | (5) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2020 | CBK | 400 | 2 | 5 | (3) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 1.200 | 0 | 9 | (9) | 0,00 |
| Gas Natural Capital Markets S.A. | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 1.000 | (249) | (127) | (122) | (0,06) |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | CBK | 1.000 | (9) | 3 | (12) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | 800 | (7) | 4 | (11) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | JPM | 500 | (4) | 3 | (7) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | BPS | $ 600 | (34) | (25) | (9) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | JPM | 1.500 | (85) | (66) | (19) | (0,02) |
| Santander International Debt SAU | 1,000 % | 20.12.2022 | BOA | € 4.300 | (160) | (91) | (69) | (0,04) |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | BRC | 400 | 3 | 7 | (4) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | GST | 800 | 7 | 16 | (9) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 5.300 | 37 | 134 | (97) | 0,01 |
| SSE PLC | 1,000 % | 20.06.2017 | GST | 1.700 | 18 | (32) | 50 | 0,00 |
| SSE PLC | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 1.200 | 17 | 9 | 8 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 2.500 | (24) | (10) | (14) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 1.100 | (10) | (4) | (6) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 700 | (7) | (2) | (5) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2021 | BPS | 200 | (3) | (8) | 5 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | 800 | (12) | (33) | 21 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 1.500 | (118) | (84) | (34) | (0,03) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | FBF | 900 | (77) | (66) | (11) | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 1.000 | (24) | (60) | 36 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 2.000 | (49) | (121) | 72 | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.03.2017 | FBF | 6.900 | (17) | 90 | (107) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 100 | (2) | (10) | 8 | 0,00 |
| | | | | | € (801) | € (453) | € (348) | (0,18) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 9.071 | JPY 1.199.000 | CBK | € 104 | € 0 | € 104 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY 1.199.000 | € 9.191 | UAG | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW 3.025.949 | $ 2.602 | FBF | 79 | (53) | 26 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD 3.281 | € 2.244 | BPS | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| 02/2016 | CHF 526 | 489 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK 2.395 | 321 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 3.410 | 457 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 4.635 | 621 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € 649 | £ 473 | BPS | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | JPY 1.199.000 | € 9.070 | CBK | 0 | (105) | (105) | (0,02) |
| 02/2016 | £ 418 | 595 | CBK | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| 02/2016 | € 4.119 | $ 4.478 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ 122.066 | € 113.903 | CBK | 1.640 | 0 | 1.640 | 0,37 |
| 02/2016 | € 2.054 | $ 2.238 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | 454 | £ 322 | FBF | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | 580 | $ 635 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | £ 28.693 | € 40.390 | JPM | 1.492 | 0 | 1.492 | 0,34 |
| 02/2016 | € 4.740 | JPY 618.900 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Credit Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € 7.522 | $ 8.000 | JPM | € 0 | € (164) | € (164) | (0,04) |
| 02/2016 | $ 17.074 | € 15.870 | JPM | 174 | (7) | 167 | 0,04 |
| 02/2016 | € 236 | $ 250 | MSB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.587 | £ 1.114 | SOG | 0 | (77) | (77) | (0,02) |
| 02/2016 | 1.093 | $ 1.160 | UAG | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| 02/2016 | $ 111.072 | € 104.325 | UAG | 2.173 | 0 | 2.173 | 0,49 |
| 02/2016 | £ 203 | 286 | UAG | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD 3.607 | $ 2.562 | SCX | 74 | (52) | 22 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD 83.609 | 2.559 | GLM | 87 | (63) | 24 | 0,01 |
| | | | | € 5.944 | € (585) | € 5.359 | 1,21 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 4.552** | **1,03** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ | 1.700 | € 1.566 | 0,35 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **€ 1.566** | **0,35** |
| **Summe Anlagen** | | | **€ 439.193** | **99,26** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | € 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 147 | 200 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 20 | 18 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 53 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 555 | 511 | 0,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 18 | 18 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 173 | 159 | 0,04 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 17 | 17 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 167 | 154 | 0,04 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 44 | 29 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 17.256 | 17.256 | 3,90 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 46 | 63 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 22 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 18.437** | **4,17** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ (15.154)** | **(3,43)** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 442.476** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 11.626 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 806 und Barmittel in Höhe von EUR 1.680 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(c) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(d) **Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(e) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von EUR 570 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(f) **Barmittel in Höhe von EUR 3.153 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 17.870 | € 414.954 | € 1.888 | € 434.712 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.566 | 0 | 1.566 |
| Finanzderivate[3] | (1.350) | 4.265 | 0 | 2.915 |
| **Summen** | **€ 16.520** | **€ 420.785** | **€ 1.888** | **€ 439.193** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 753.908 | € 5.671 | € 759.579 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 2.567 | 0 | 2.567 |
| Finanzderivate[3] | 4.388 | (15.189) | 0 | (10.801) |
| **Summen** | **€ 4.388** | **€ 741.286** | **€ 5.671** | **€ 751.345** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | (0,080 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | € 5.724 | € (5.723) | (1,29) |
| MYI | (0,060 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 5.465 | (5.465) | (1,24) |
| | | | | | € (11.188) | (2,53) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (184) | € 0 | € (184) |
| BPS | (2) | 0 | (2) |
| BRC | (134) | 270 | 136 |
| CBK | 1.610 | (2.060) | (450) |
| DUB | 4 | (150) | (146) |
| FBF | (85) | 50 | (35) |
| GLM | 24 | 0 | 24 |
| GST | 60 | 0 | 60 |
| HUS | 4 | 0 | 4 |
| JPM | 1.392 | (1.520) | (128) |
| MSB | (6) | 0 | (6) |
| MYC | (249) | 250 | 1 |
| SCX | 22 | 0 | 22 |
| SOG | (77) | 0 | (77) |
| UAG | 2.173 | (2.641) | (468) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,25 | 102,73 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,31) | 0,59 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,06) | (0,21) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,03 | (1,84) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,35 | 0,35 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Credit Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 87.000 | € | 88.526 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,250 % fällig am 15.05.2016 | | 33.600 | | 34.307 |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro 0,088 % fällig am 12.02.2016 | | 32.400 | | 32.367 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 24.300 | | 26.474 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 21.200 | | 25.671 |
| France Treasury Bills (0,113)% fällig am 06.05.2015 | | 25.300 | | 25.307 |
| Spain Letras del Tesoro 0,032 % fällig am 15.07.2016 | | 24.500 | | 24.494 |
| France Treasury Bills (0,120)% fällig am 23.07.2015 | | 19.210 | | 19.221 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 175.700 | | 17.853 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,250 % fällig am 18.10.2017 | € | 16.200 | | 16.298 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 15.04.2016 | | 15.200 | | 15.754 |
| France Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.03.2015 | | 15.200 | | 15.202 |
| French Treasury Notes 2,000 % fällig am 12.07.2015 | | 14.300 | | 14.441 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 11.400 | | 11.816 |
| Spain Government Bond 3,750 % fällig am 31.10.2015 | | 11.200 | | 11.453 |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro 0,000 % fällig am 14.07.2016 | | 11.380 | | 11.377 |
| Metropolitan Life Global Funding 1,250 % fällig am 17.09.2021 | | 10.500 | | 10.749 |
| Deutsche Bank AG 2,750 % fällig am 17.02.2025 | | 9.000 | | 9.219 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,500 % fällig am 01.11.2022 | | 7.200 | | 9.208 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 9.600 | | 8.565 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 87.000 | € | 88.440 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 38.600 | | 42.117 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 32.800 | | 40.039 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,250 % fällig am 15.05.2016 | | 33.600 | | 34.211 |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro 0,088 % fällig am 12.02.2016 | | 32.400 | | 32.388 |
| France Treasury Bills (0,113)% fällig am 06.05.2015 | | 24.602 | | 24.607 |
| Spain Letras del Tesoro 0,032 % fällig am 15.07.2016 | | 24.500 | | 24.495 |
| France Treasury Bills (0,120)% fällig am 23.07.2015 | | 19.210 | | 19.220 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,500 % fällig am 01.11.2022 | | 14.400 | | 18.284 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,250 % fällig am 18.10.2017 | | 16.200 | | 16.327 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 15.04.2016 | | 15.200 | | 15.706 |
| France Treasury Bills 0,000 % fällig am 18.03.2015 | | 15.200 | | 15.201 |
| French Treasury Notes 2,000 % fällig am 12.07.2015 | | 14.300 | | 14.433 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 11.400 | | 11.716 |
| Intesa Sanpaolo SpA 3,125 % fällig am 15.01.2016 | $ | 13.031 | | 11.535 |
| Spain Government Bond 3,750 % fällig am 31.10.2015 | € | 11.200 | | 11.445 |
| Italy Buoni Ordinari del Tesoro 0,000 % fällig am 14.07.2016 | | 11.380 | | 11.378 |
| France Treasury Bills (0,008)% fällig am 13.05.2015 | | 10.800 | | 10.803 |
| Intesa Sanpaolo SpA 6,500 % fällig am 24.02.2021 | $ | 8.800 | | 9.328 |
| Deutsche Bank AG 2,750 % fällig am 17.02.2025 | € | 9.000 | | 9.135 |

(a) Der Euro Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | $ | 1.386 | € 1.253 | 0,16 |
| 3,000 % fällig am 04.01.2021 | | 2.344 | 2.121 | 0,27 |
| 3,500 % fällig am 24.01.2023 | | 800 | 736 | 0,09 |
| **Commscope, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.12.2022 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,828 % fällig am 29.12.2022 | | 299 | 273 | 0,03 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 3.069 | 2.807 | 0,35 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 2.155 | 1.980 | 0,25 |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.06.2019 | | 1.990 | 1.375 | 0,17 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 3,424 % fällig am 27.02.2021 | | 786 | 718 | 0,09 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 1.782 | 1.640 | 0,21 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 111 | 102 | 0,01 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 30.06.2019 | | 800 | 698 | 0,09 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.12.2019 | | 495 | 451 | 0,06 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 2.550 | 2.292 | 0,29 |
| **Ziggo B.V.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2022 | € | 943 | 924 | 0,12 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2022 | | 521 | 511 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 15.11.2022 | | 309 | 302 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2022 | | 27 | 26 | 0,00 |
| | | | 18.210 | 2,29 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | $ | 3.500 | 3.218 | 0,40 |
| 6,250 % fällig am 13.09.2022 | | 722 | 699 | 0,09 |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.05.2019 | | 2.600 | 2.396 | 0,30 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 2.800 | 2.661 | 0,33 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.02.2018 | | 7.100 | 6.520 | 0,82 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 500 | 461 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 2.600 | 2.367 | 0,30 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 200 | 190 | 0,02 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 2.200 | 2.268 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | | 2.500 | 2.662 | 0,33 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | | 7.300 | 7.330 | 0,92 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 4.800 | 4.721 | 0,59 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 1.800 | 1.780 | 0,22 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | € | 5.200 | 5.338 | 0,67 |
| **Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | $ | 5.500 | 5.069 | 0,64 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | € | 4.600 | 4.315 | 0,54 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 2.045 | 2.147 | 0,27 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 1.400 | 1.377 | 0,17 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 4.570 | 8.012 | 1,01 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 1.000 | 1.758 | 0,22 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.100 | 1.117 | 0,14 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.200 | 1.631 | 0,21 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | € | 9.900 | 10.173 | 1,28 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | $ | 12.900 | 11.573 | 1,45 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | $ | 3.900 | € 3.780 | 0,47 |
| 12,500 % fällig am 29.08.2049 | | 1.200 | 1.417 | 0,18 |
| 12,500 % fällig am 29.09.2049 | € | 1.400 | 1.880 | 0,24 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | $ | 1.800 | 1.698 | 0,21 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | | 100 | 95 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 8.100 | 7.717 | 0,97 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.06.2045 | € | 800 | 790 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 30.09.2041 | | 3.900 | 4.565 | 0,57 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 9.700 | 11.567 | 1,45 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.650 | 3.021 | 0,38 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | £ | 3.400 | 5.036 | 0,63 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 100 | 149 | 0,02 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.03.2027 | € | 3.700 | 3.539 | 0,44 |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 3.200 | 3.296 | 0,41 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 4.800 | 6.419 | 0,81 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | $ | 700 | 713 | 0,09 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 | € | 1.000 | 1.092 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 11.200 | 11.133 | 1,40 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | | 600 | 554 | 0,07 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 1.750 | 1.612 | 0,20 |
| **Franz Haniel & Cie GmbH** | | | | |
| 6,250 % fällig am 08.02.2018 | € | 1.100 | 1.222 | 0,15 |
| **Heta Asset Resolution AG (a)** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2016 | | 1.500 | 1.020 | 0,13 |
| 2,750 % fällig am 31.05.2016 | CHF | 6.300 | 3.853 | 0,48 |
| 4,375 % fällig am 24.01.2017 | € | 13.350 | 9.078 | 1,14 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 700 | 701 | 0,09 |
| **Inmobiliaria Colonial S.A.** | | | | |
| 2,728 % fällig am 05.06.2023 | € | 5.400 | 5.356 | 0,67 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2018 | $ | 4.000 | 3.719 | 0,47 |
| 5,875 % fällig am 01.04.2019 | | 200 | 196 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 200 | 197 | 0,03 |
| 8,875 % fällig am 01.09.2017 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.01.2018 | | 5.300 | 5.005 | 0,63 |
| 3,928 % fällig am 15.09.2026 | € | 4.600 | 4.734 | 0,59 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 4.000 | 3.629 | 0,46 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 11.200 | 11.708 | 1,47 |
| 6,625 % fällig am 08.05.2018 | € | 3.900 | 4.207 | 0,53 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.08.2021 | $ | 700 | 686 | 0,09 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 6.400 | 6.437 | 0,81 |
| **La Mondiale SAM** | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | € | 500 | 506 | 0,06 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.10.2017 | $ | 200 | 185 | 0,02 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.06.2049 | € | 3.323 | 3.514 | 0,44 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,033 % fällig am 15.12.2030 | £ | 872 | 1.064 | 0,13 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.09.2017 | $ | 1.000 | 909 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 17.06.2019 | | 7.100 | 6.029 | 0,76 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 500 | 432 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 665 | 614 | 0,08 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 4.752 | 4.615 | 0,58 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 08.04.2044 | € | 2.100 | 2.189 | 0,28 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 700 | 609 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 3.100 | 2.724 | 0,34 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 300 | 263 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 2.400 | 2.149 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 1.200 | 1.086 | 0,14 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 1.756 | 1.690 | 0,21 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 2.100 | 279 | 0,04 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2025 | $ | 200 | € 180 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 01.04.2024 | | 200 | 186 | 0,02 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.02.2024 | € | 600 | 648 | 0,08 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 8.900 | 1.188 | 0,15 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 21.391 | 21.362 | 2,68 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 800 | 590 | 0,07 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 3.100 | 4.283 | 0,54 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 1.900 | 1.870 | 0,24 |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | $ | 800 | 742 | 0,09 |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | | 100 | 94 | 0,01 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 2.700 | 2.459 | 0,31 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2016 | | 200 | 187 | 0,02 |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 2.500 | 2.388 | 0,30 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 3.118 | 3.988 | 0,50 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | $ | 1.200 | 1.124 | 0,14 |
| 4,750 % fällig am 12.02.2026 | € | 1.000 | 1.070 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 6.200 | 5.779 | 0,73 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 5.200 | 5.008 | 0,63 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 3.450 | 3.625 | 0,46 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 500 | 526 | 0,07 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 800 | 773 | 0,10 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 1.300 | 1.624 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 3.150 | 4.199 | 0,53 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | $ | 100 | 95 | 0,01 |
| | | | 314.750 | 39,51 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,720 % fällig am 31.07.2018 | £ | 3.500 | 4.940 | 0,62 |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.04.2020 (b) | € | 4.800 | 4.512 | 0,57 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | | 6.800 | 6.801 | 0,85 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.12.2023 | | 3.900 | 4.024 | 0,51 |
| **Cemex SAB de C.V.** | | | | |
| 5,071 % fällig am 15.10.2018 | $ | 200 | 180 | 0,02 |
| 9,500 % fällig am 15.06.2018 | | 3.300 | 3.250 | 0,41 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.06.2020 | | 200 | 186 | 0,02 |
| **Continental Airlines 2009-2 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.11.2019 | | 72 | 75 | 0,01 |
| **Continental Airlines 2010-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.01.2021 | | 230 | 224 | 0,03 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2025 | € | 7.000 | 6.580 | 0,83 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | | 500 | 513 | 0,06 |
| **Debenhams PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2021 | £ | 3.200 | 4.342 | 0,55 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | $ | 5.500 | 5.025 | 0,63 |
| **Endo Finance LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2022 | | 1.200 | 1.077 | 0,14 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | £ | 1.300 | 1.881 | 0,24 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | $ | 1.500 | 1.408 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 2.300 | 2.180 | 0,27 |
| **Finmeccanica SpA** | | | | |
| 4,500 % fällig am 19.01.2021 | € | 500 | 545 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 6.300 | 9.995 | 1,26 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | |
| 1,700 % fällig am 27.05.2016 | $ | 200 | 183 | 0,02 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Goldcorp, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 09.06.2021 | $ | 400 | € 346 | 0,04 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 2,663 % fällig am 15.03.2036 | £ | 2.300 | 2.703 | 0,34 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 1.078 | 1.625 | 0,20 |
| **Greif Nevada Holdings, Inc. SCS** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.07.2021 | € | 3.400 | 3.955 | 0,50 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | | 1.800 | 1.674 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 31.800 | 224 | 0,03 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 500 | 463 | 0,06 |
| **Ineos Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2023 | | 9.500 | 9.108 | 1,14 |
| **Kloeckner Pentaplast of America, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.11.2020 | | 5.000 | 5.127 | 0,64 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | $ | 4.900 | 4.229 | 0,53 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2022 | € | 1.200 | 1.230 | 0,15 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 4.400 | 4.472 | 0,56 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 3.700 | 3.312 | 0,42 |
| **Premier Foods Finance PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2021 | £ | 4.200 | 5.455 | 0,69 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.02.2025 | $ | 600 | 513 | 0,06 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | | 3.900 | 3.442 | 0,43 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 03.04.2018 | | 4.721 | 4.433 | 0,56 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 1.800 | 1.470 | 0,18 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | | 500 | 440 | 0,06 |
| 6,850 % fällig am 15.07.2018 | | 5.100 | 4.624 | 0,58 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.11.2016 | | 5.100 | 4.695 | 0,59 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.07.2017 | | 1.700 | 1.633 | 0,21 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 10.000 | 9.750 | 1,22 |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.07.2027 | | 5.700 | 5.550 | 0,70 |
| **Soho House Bond Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.10.2018 | £ | 100 | 142 | 0,02 |
| **Solvay Finance S.A.** | | | | |
| 5,869 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.500 | 2.494 | 0,31 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | £ | 1.200 | 1.706 | 0,21 |
| **Stonegate Pub Co. Financing PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.04.2019 | | 2.800 | 3.875 | 0,49 |
| **TDF Infrastructure SAS** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | € | 2.600 | 2.671 | 0,34 |
| **TeamSystem Holding SpA** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | | 3.500 | 3.640 | 0,46 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | $ | 100 | 90 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 200 | 175 | 0,02 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 6,542 % fällig am 28.04.2020 | | 2.600 | 2.501 | 0,31 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 2.637 | 3.576 | 0,45 |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 299 | 425 | 0,05 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | € | 3.500 | 3.235 | 0,41 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2023 | | 1.296 | 1.380 | 0,17 |
| **US Airways 2012-2 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,625 % fällig am 03.06.2025 | $ | 1.327 | 1.269 | 0,16 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 10.500 | 9.165 | 1,15 |
| **Viacom, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | $ | 5.000 | 4.320 | 0,54 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | € | 5.200 | 5.200 | 0,65 |
| 7,000 % fällig am 23.04.2021 | | 5.800 | 5.757 | 0,72 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | | 2.400 | 2.302 | 0,29 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | € | 3.200 | € 2.970 | 0,37 |
| | | | 195.287 | 24,52 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | £ | 300 | 431 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | $ | 4.500 | 4.381 | 0,55 |
| **EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG** | | | | |
| 7,375 % fällig am 02.04.2072 | € | 4.300 | 4.567 | 0,57 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | $ | 1.100 | 958 | 0,12 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 4.000 | 3.977 | 0,50 |
| **Iberdrola International BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.02.2049 | € | 8.700 | 9.361 | 1,18 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.03.2049 | | 7.350 | 7.825 | 0,98 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.** | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | $ | 800 | 655 | 0,08 |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | | 4.300 | 3.978 | 0,50 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.01.2018 | | 5.100 | 4.918 | 0,62 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | € | 8.000 | 7.997 | 1,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | $ | 100 | 85 | 0,01 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | | 250 | 254 | 0,03 |
| **RWE Finance BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 2.700 | 4.154 | 0,52 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | $ | 1.200 | 939 | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 1.000 | 805 | 0,10 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | | 200 | 188 | 0,02 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | | 5.200 | 4.996 | 0,63 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 3,250 % fällig am 16.01.2023 | € | 3.400 | 3.454 | 0,43 |
| 6,375 % fällig am 24.06.2019 | £ | 5.550 | 8.193 | 1,03 |
| **Telefonica Europe BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.09.2049 | € | 3.500 | 3.689 | 0,46 |
| **Williams Cos., Inc.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | $ | 1.000 | 695 | 0,09 |
| | | | 76.500 | 9,60 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 586.537 | 73,63 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,190 % fällig am 14.01.2016 (c)(d) | | 1.388 | 1.278 | 0,16 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.12.2036 | | 313 | 116 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.07.2036 | | 474 | 305 | 0,04 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | | 119 | 99 | 0,01 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,799 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 512 | 427 | 0,05 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,440 % fällig am 25.05.2036 | | 98 | 73 | 0,01 |
| 2,673 % fällig am 25.09.2034 | | 16 | 15 | 0,00 |
| 4,381 % fällig am 25.06.2047 (a) | | 338 | 277 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2033 | | 1.812 | 1.703 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2034 | | 27 | 25 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 197 | 145 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 202 | 162 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 149 | 125 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 (a) | | 234 | 192 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2034 | | 153 | 140 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 337 | 276 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 364 | 290 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 584 | 506 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 154 | 125 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 1.562 | 1.178 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 692 | 532 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 3.139 | 2.494 | 0,31 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 (a) | $ | 43 | € 32 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 116 | 86 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 535 | 344 | 0,04 |
| **Alternative Loan Trust Resecuritization** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 252 | 187 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 1,177 % fällig am 25.11.2046 | | 705 | 334 | 0,04 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.06.2036 | | 597 | 200 | 0,03 |
| 0,532 % fällig am 25.09.2036 | | 556 | 200 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 1.150 | 416 | 0,05 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | | 883 | 629 | 0,08 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.01.2037 | | 279 | 159 | 0,02 |
| 1,422 % fällig am 25.06.2037 | | 154 | 105 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.03.2034 | | 421 | 313 | 0,04 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,331 % fällig am 15.08.2033 | | 40 | 34 | 0,00 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.10.2033 | | 898 | 870 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 447 | 354 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 (a) | | 839 | 640 | 0,08 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 20.10.2036 | | 250 | 180 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 228 | 151 | 0,02 |
| 2,684 % fällig am 20.09.2046 (a) | | 164 | 126 | 0,02 |
| 2,870 % fällig am 20.11.2035 (a) | | 246 | 202 | 0,03 |
| 2,873 % fällig am 20.04.2035 (a) | | 337 | 229 | 0,03 |
| 2,973 % fällig am 20.09.2047 (a) | | 404 | 278 | 0,04 |
| 5,052 % fällig am 20.09.2046 (a) | | 224 | 170 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 1.833 | 1.485 | 0,19 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 45 | 35 | 0,00 |
| **BCAP LLC** | | | | |
| 9,934 % fällig am 26.10.2036 | | 421 | 369 | 0,05 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,280 % fällig am 26.07.2036 | | 331 | 305 | 0,04 |
| 2,756 % fällig am 26.03.2037 | | 300 | 222 | 0,03 |
| 4,459 % fällig am 27.03.2037 | | 444 | 276 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 | | 68 | 57 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,622 % fällig am 25.08.2035 | | 143 | 117 | 0,01 |
| 2,662 % fällig am 25.02.2035 | | 44 | 37 | 0,00 |
| 2,727 % fällig am 25.12.2046 (a) | | 1.075 | 857 | 0,11 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust (a)** | | | | |
| 2,820 % fällig am 25.05.2036 | | 294 | 187 | 0,02 |
| 3,048 % fällig am 25.09.2035 | | 501 | 349 | 0,04 |
| 4,193 % fällig am 25.11.2036 | | 177 | 118 | 0,02 |
| 4,687 % fällig am 25.05.2036 | | 901 | 583 | 0,07 |
| 4,864 % fällig am 25.07.2035 | | 977 | 743 | 0,09 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 (a) | | 498 | 455 | 0,06 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.09.2046 | | 297 | 235 | 0,03 |
| 8,419 % fällig am 25.10.2036 | | 81 | 54 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.08.2036 | | 77 | 67 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,650 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 989 | 837 | 0,11 |
| 4,840 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 111 | 96 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 203 | 160 | 0,02 |
| **ChaseFlex Trust (a)** | | | | |
| 4,507 % fällig am 25.08.2037 | | 67 | 52 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 | | 204 | 166 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,391 % fällig am 25.10.2046 | | 173 | 158 | 0,02 |
| 0,752 % fällig am 25.12.2034 | | 36 | 29 | 0,00 |
| 2,756 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 206 | 156 | 0,02 |
| 5,050 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 143 | 120 | 0,02 |
| 5,302 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 695 | 561 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 259 | 192 | 0,02 |
| 6,351 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 231 | 140 | 0,02 |
| 6,362 % fällig am 25.11.2037 | | 271 | 218 | 0,03 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust (a)** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 | | 34 | 32 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 795 | 637 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | $ | 1.352 | € | 1.094 | 0,14 |
| **COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 5,766 % fällig am 15.05.2046 | | 323 | | 311 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.06.2047 | | 431 | | 376 | 0,05 |
| 0,662 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 459 | | 375 | 0,05 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.03.2035 | | 492 | | 411 | 0,05 |
| 1,042 % fällig am 25.03.2035 | | 68 | | 54 | 0,01 |
| 1,162 % fällig am 25.02.2035 | | 657 | | 510 | 0,06 |
| 2,629 % fällig am 20.02.2036 | | 700 | | 555 | 0,07 |
| 2,718 % fällig am 25.09.2047 (a) | | 364 | | 303 | 0,04 |
| 2,741 % fällig am 20.09.2036 (a) | | 76 | | 62 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 20.12.2035 (a) | | 239 | | 195 | 0,02 |
| 2,760 % fällig am 25.11.2037 | | 509 | | 420 | 0,05 |
| 4,325 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 236 | | 205 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 269 | | 233 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 300 | | 262 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 48 | | 42 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 416 | | 329 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 786 | | 654 | 0,08 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. (a)** | | | | | |
| 1,572 % fällig am 25.09.2034 | | 167 | | 132 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 | | 395 | | 284 | 0,04 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | | | |
| 2,986 % fällig am 28.08.2036 | | 153 | | 137 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | | |
| 2,087 % fällig am 27.09.2036 | | 210 | | 194 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 5.331 | | 3.448 | 0,43 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 183 | | 129 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 (a) | | 503 | | 394 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 (a) | | 1.031 | | 671 | 0,08 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc.** | | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.04.2037 | | 587 | | 284 | 0,04 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | | |
| 0,783 % fällig am 15.06.2040 | £ | 266 | | 326 | 0,04 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust (a)** | | | | | |
| 2,299 % fällig am 25.04.2036 | $ | 328 | | 256 | 0,03 |
| 2,369 % fällig am 25.01.2036 | | 750 | | 557 | 0,07 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,619 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 152 | | 124 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.08.2037 | | 73 | | 34 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.08.2037 | | 234 | | 111 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.08.2037 | | 78 | | 38 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 328 | | 158 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.08.2036 | | 253 | | 96 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 | | 1.044 | | 545 | 0,07 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | | |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 211 | | 116 | 0,01 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.12.2046 | | 322 | | 163 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 506 | | 223 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.12.2046 | | 884 | | 453 | 0,06 |
| 0,622 % fällig am 25.11.2036 | | 321 | | 168 | 0,02 |
| 0,652 % fällig am 25.12.2046 | | 161 | | 83 | 0,01 |
| **GSC Capital Corporation Mortgage Trust** | | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 279 | | 200 | 0,03 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 | | 629 | | 603 | 0,08 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust (a)** | | | | | |
| 2,762 % fällig am 19.12.2035 | | 291 | | 204 | 0,03 |
| 2,803 % fällig am 19.12.2035 | | 166 | | 136 | 0,02 |
| 4,007 % fällig am 19.06.2036 | | 231 | | 146 | 0,02 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | £ | 324 | | 433 | 0,05 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 2,022 % fällig am 25.12.2034 | $ | 985 | | 730 | 0,09 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 647 | | 519 | 0,07 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.12.2036 | | 293 | | 115 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | | 1.407 | | 554 | 0,07 |
| 0,642 % fällig am 25.12.2036 | | 814 | | 324 | 0,04 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | | 1.371 | | 896 | 0,11 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | $ | 705 | € | 560 | 0,07 |
| **IndyMac IMJA Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 86 | | 67 | 0,01 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,899 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 2.789 | | 1.908 | 0,24 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.01.2035 | | 131 | | 94 | 0,01 |
| 2,389 % fällig am 25.06.2037 | | 400 | | 208 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 260 | | 203 | 0,03 |
| 4,182 % fällig am 25.06.2036 | | 141 | | 120 | 0,02 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 0,732 % fällig am 27.06.2037 | | 793 | | 600 | 0,08 |
| 3,219 % fällig am 25.12.2036 | | 88 | | 75 | 0,01 |
| 6,050 % fällig am 25.05.2036 | | 228 | | 192 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 429 | | 345 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 5,059 % fällig am 25.11.2036 | | 1.200 | | 1.118 | 0,14 |
| 6,337 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 177 | | 113 | 0,01 |
| **Lavender Trust** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036 | | 235 | | 162 | 0,02 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | | |
| 5,359 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 340 | | 293 | 0,04 |
| 5,617 % fällig am 25.12.2035 | | 400 | | 289 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 474 | | 326 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | | 545 | | 446 | 0,06 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 2.162 | | 1.130 | 0,14 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | £ | 152 | | 199 | 0,03 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | | |
| 2,868 % fällig am 25.03.2035 | $ | 59 | | 48 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 0,472 % fällig am 25.11.2036 | | 207 | | 88 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | | 378 | | 167 | 0,02 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | | 221 | | 112 | 0,01 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | | 227 | | 102 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 293 | | 236 | 0,03 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.11.2037 | | 923 | | 430 | 0,05 |
| 2,658 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 673 | | 418 | 0,05 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.09.2036 | | 77 | | 33 | 0,00 |
| 0,532 % fällig am 25.02.2037 | | 647 | | 274 | 0,03 |
| 0,552 % fällig am 25.01.2037 | | 161 | | 83 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | | 174 | | 89 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | | 676 | | 413 | 0,05 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 458 | | 195 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.03.2037 | | 510 | | 242 | 0,03 |
| 0,622 % fällig am 25.02.2037 | | 173 | | 89 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | | 510 | | 245 | 0,03 |
| 1,472 % fällig am 25.06.2033 | | 62 | | 54 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.04.2037 | | 439 | | 229 | 0,03 |
| 0,652 % fällig am 25.04.2037 | | 264 | | 139 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust (a)** | | | | | |
| 2,862 % fällig am 25.03.2036 | | 392 | | 294 | 0,04 |
| 5,962 % fällig am 25.06.2036 | | 6.300 | | 3.045 | 0,38 |
| 5,965 % fällig am 25.09.2046 | | 534 | | 323 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 124 | | 95 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.08.2047 | | 92 | | 87 | 0,01 |
| **Newgate Funding** | | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 445 | | 413 | 0,05 |
| 1,583 % fällig am 15.12.2050 | £ | 354 | | 438 | 0,06 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust (a)** | | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.02.2037 | $ | 151 | | 52 | 0,01 |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 | | 208 | | 103 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 0,371 % fällig am 25.06.2036 | | 181 | | 123 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 248 | | 121 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | | 89 | | 47 | 0,01 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | | 444 | | 239 | 0,03 |
| 0,752 % fällig am 25.04.2037 | | 168 | | 96 | 0,01 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | | |
| 9,391 % fällig am 26.06.2037 | | 671 | | 365 | 0,05 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,222 % fällig am 25.09.2037 | $ | 369 | € | 272 | 0,03 |
| 5,812 % fällig am 25.11.2036 | | 572 | | 290 | 0,04 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 3.563 | | 1.678 | 0,21 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 281 | | 156 | 0,02 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.06.2037 | | 181 | | 129 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 | | 165 | | 155 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 230 | | 180 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 171 | | 133 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 423 | | 308 | 0,04 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | | |
| 5,641 % fällig am 25.07.2034 (a) | | 114 | | 99 | 0,01 |
| 6,011 % fällig am 25.12.2033 | | 37 | | 33 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 566 | | 399 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 238 | | 157 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 175 | | 111 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 165 | | 107 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 1.623 | | 1.297 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 119 | | 78 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 173 | | 143 | 0,02 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | | |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | £ | 926 | | 1.147 | 0,14 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | | |
| 0,512 % fällig am 25.07.2036 | $ | 291 | | 131 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 25.07.2036 | | 285 | | 130 | 0,02 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | | 244 | | 113 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.05.2036 | | 1.073 | | 570 | 0,07 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.02.2037 | | 340 | | 133 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.02.2037 | | 503 | | 199 | 0,03 |
| 0,702 % fällig am 25.06.2037 | | 264 | | 152 | 0,02 |
| 1,372 % fällig am 25.10.2037 | | 540 | | 346 | 0,04 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2037 | | 167 | | 91 | 0,01 |
| **STAdjustable Rate Mortgage Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 6,005 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 659 | | 516 | 0,06 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust (a)** | | | | | |
| 2,541 % fällig am 25.02.2036 | | 172 | | 128 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.10.2035 | | 621 | | 513 | 0,06 |
| 2,754 % fällig am 25.06.2036 | | 110 | | 87 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 266 | | 196 | 0,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.09.2047 (a) | | 734 | | 469 | 0,06 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,695 % fällig am 25.08.2032 | | 169 | | 144 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | | 88 | | 83 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 2,598 % fällig am 25.12.2035 | | 50 | | 43 | 0,01 |
| 3,824 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 892 | | 749 | 0,09 |
| 4,432 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 206 | | 168 | 0,02 |
| 6,008 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 104 | | 80 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | | |
| 1,027 % fällig am 25.04.2047 | | 1.001 | | 674 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 268 | | 198 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 99 | | 82 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 188 | | 169 | 0,02 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust (a)** | | | | | |
| 2,668 % fällig am 25.03.2036 | | 228 | | 207 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 252 | | 231 | 0,03 |
| **Windermere XIV CMBS Ltd.** | | | | | |
| 0,397 % fällig am 22.04.2018 | € | 88 | | 84 | 0,01 |
| | | | | 77.457 | 9,72 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Ares European CLO III BV** | | | | | |
| 0,256 % fällig am 15.08.2024 | | 66 | | 66 | 0,01 |
| **LCM X LP** | | | | | |
| 1,581 % fällig am 15.04.2022 | $ | 5.743 | | 5.278 | 0,66 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 1,470 % fällig am 25.07.2023 | $ | 4.000 | € 3.672 | 0,46 |
| **Octagon Investment Partners XII Ltd.** | | | | |
| 1,604 % fällig am 05.05.2023 | | 10.269 | 9.445 | 1,19 |
| | | | 18.461 | 2,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | € | 4.800 | 5.078 | 0,64 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.09.2017 | | 150 | 141 | 0,02 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 347.000 | 2.390 | 0,30 |
| 4,500 % fällig am 08.11.2016 | | 310.000 | 2.254 | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 03.07.2017 | | 310.000 | 2.182 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 201.300 | € 1.487 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 41.900 | 309 | 0,04 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 (b) | € | 9.900 | 11.753 | 1,47 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 (b) | | 10.200 | 11.136 | 1,40 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| (0,051 %) fällig am 18.11.2016 | | 80 | 80 | 0,01 |
| | | | 36.810 | 4,62 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (e)** | | 257.700 | 26.211 | 3,29 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| (0,320 %) fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert vom Land Hessen 0,875 % fällig am 10.12.2024 bewertet mit €15.671. Die Rückkauferlöse betragen €16.001.) | € | 16.000 | € 16.000 | 2,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€ 780.964** | **98,04** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.798 | € (538) | (0,07) |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 450 | (459) | (0,06) |
| | | | | € (997) | (0,13) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (997)** | **(0,13)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 62.700 | € (216) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 52.100 | € (125) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | 6.800 | (38) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2019 | 111.400 | (1.262) | (0,16) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 15.06.2021 | 11.700 | 48 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 61.000 | (1.539) | (0,19) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 20.300 | 63 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 2.800 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 3.100 | (229) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,200 % | 18.06.2018 | € 117.200 | 803 | 0,10 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 18.03.2022 | 12.900 | 16 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 4.800 | 22 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | £ 30.600 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 14.700 | (54) | (0,01) |
| | | | | | € (2.265) | (0,28) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (2.481)** | **(0,31)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - iTraxx Europe Series 24 Index | BRC | Verkauf | 1,050 % | 20.01.2016 | € 9.100 | € (18) | € (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | $ 1.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 3.100 | (5) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 7.000 | (13) | (6) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 3.100 | (6) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | € (44) | € (10) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | € 3.200 | € 47 | € 44 | € 3 | 0,01 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 300 | 4 | (4) | 8 | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 5.500 | 80 | 74 | 6 | 0,01 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 2.000 | 1 | 15 | (14) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 1.500 | 0 | 12 | (12) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2020 | CBK | 400 | 2 | 5 | (3) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 3.600 | 1 | 27 | (26) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 100 | 0 | 1 | (1) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | $ 5.600 | (851) | (671) | (180) | (0,11) |
| Gas Natural Capital Markets S.A. | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | € 1.000 | (3) | 2 | (5) | 0,00 |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 2.800 | (696) | (122) | (574) | (0,09) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 1.000 | (249) | (96) | (153) | (0,03) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 800 | (199) | (77) | (122) | (0,03) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 2.000 | (497) | (196) | (301) | (0,06) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 1.500 | (373) | (145) | (228) | (0,05) |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | CBK | 200 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | 200 | (2) | 1 | (3) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | JPM | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | $ 800 | (183) | (30) | (153) | (0,02) |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | BRC | € 400 | (10) | 1 | (11) | 0,00 |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | JPM | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Santander International Debt SAU | 1,000 % | 20.12.2022 | BOA | 3.200 | (119) | (68) | (51) | (0,02) |
| Santander International Debt SAU | 1,000 % | 20.12.2022 | FBF | 2.700 | (100) | (65) | (35) | (0,01) |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | BRC | 300 | 3 | 6 | (3) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | GST | 900 | 8 | 18 | (10) | 0,00 |
| SSE PLC | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 1.700 | 24 | 13 | 11 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 2.500 | (24) | (10) | (14) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 2.300 | (22) | (9) | (13) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 1.800 | 6 | 15 | (9) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2019 | FBF | 400 | 1 | (8) | 9 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.06.2021 | FBF | 9.700 | (149) | (386) | 237 | (0,02) |
| Telefonica Emisiones SAU | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 1.500 | (14) | (4) | (10) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 400 | (10) | (26) | 16 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 2.300 | (56) | (156) | 100 | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 4.800 | (117) | (315) | 198 | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 3.100 | (75) | (157) | 82 | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 1.200 | (29) | (124) | 95 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 1.500 | (36) | (149) | 113 | 0,00 |
| | | | | | € (3.643) | € (2.584) | € (1.059) | (0,46) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 7.779 | € | 5.277 | CBK | € 67 | € 0 | € 67 | 0,01 |
| 01/2016 | € | 27.195 | JPY | 3.594.700 | CBK | 313 | 0 | 313 | 0,04 |
| 01/2016 | JPY | 3.594.700 | € | 27.556 | UAG | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| 01/2016 | KRW | 6.520.925 | $ | 5.608 | FBF | 170 | (113) | 57 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 447 | € | 306 | BPS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 4.330 | | 4.022 | JPM | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 4.885 | | 655 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.705 | | 229 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.105 | | 282 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.310 | | 310 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € | 4.554 | £ | 3.292 | BOA | € 0 | € (91) | € (91) | (0,01) |
| 02/2016 | | 41.295 | $ | 45.322 | BOA | 387 | 0 | 387 | 0,05 |
| 02/2016 | | 3.754 | | 4.107 | BPS | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2016 | | 15.545 | £ | 11.258 | BPS | 0 | (283) | (283) | (0,04) |
| 02/2016 | $ | 3.859 | € | 3.515 | BPS | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 546 | | 749 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 27.235 | $ | 29.664 | CBK | 52 | (5) | 47 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 3.594.700 | € | 27.191 | CBK | 0 | (315) | (315) | (0,04) |
| 02/2016 | $ | 269.882 | | 251.853 | CBK | 3.648 | (2) | 3.646 | 0,46 |
| 02/2016 | € | 3.773 | £ | 2.747 | CBK | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| 02/2016 | | 24.190 | $ | 26.324 | DUB | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 87.476 | € | 123.074 | HUS | 4.487 | 0 | 4.487 | 0,56 |
| 02/2016 | € | 2.901 | $ | 3.167 | HUS | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | | 439 | £ | 310 | JPM | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 491 | € | 693 | JPM | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 6.023 | $ | 6.455 | JPM | 17 | (103) | (86) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 27.017 | € | 25.221 | JPM | 392 | (18) | 374 | 0,05 |
| 02/2016 | € | 9.498 | JPY | 1.240.100 | JPM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | | 11.996 | $ | 13.023 | MSB | 72 | (91) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.747 | € | 2.527 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 213.498 | | 200.524 | UAG | 4.172 | 0 | 4.172 | 0,52 |
| 02/2016 | € | 28.106 | $ | 30.174 | UAG | 66 | (421) | (355) | (0,04) |
| 02/2016 | £ | 789 | € | 1.113 | UAG | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 169.399 | $ | 5.185 | GLM | 175 | (127) | 48 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 254 | MXN | 4.374 | BOA | 3 | (5) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | € 14.249 | € (1.686) | € 12.563 | 1,58 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 8.910** | **1,12** |
| **Summe Anlagen** | **€ 786.396** | **98,72** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 603 | € 818 | 0,10 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 37 | 34 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 706 | 473 | 0,06 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 54.351 | 416 | 0,05 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.026 | 944 | 0,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 37 | 37 | 0,01 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 536 | 4 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 3 | 4 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 11 | 10 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 6 | 4 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 72 | 4 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 320 | 295 | 0,04 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 34 | 34 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 334 | 20 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 308 | 284 | 0,04 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 414 | 277 | 0,04 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 8 | 6 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 34.953 | 34.953 | 4,39 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 22.892 | 175 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 190 | 258 | 0,03 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7 | 7 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 39.059** | **4,90** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ (28.893)** | **(3,62)** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 796.562** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 25.773 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 476 und Barmittel in Höhe von EUR 3.025 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 802 und Barmittel in Höhe von EUR 2.756 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(e) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(f) Barmittel in Höhe von EUR 6.245 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 26.211 | € 754.753 | € 0 | € 780.964 |
| Finanzderivate[3] | (997) | 6.429 | 0 | 5.432 |
| **Summen** | **€ 25.214** | **€ 761.182** | **€ 0** | **€ 786.396** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 4.253 | € 996.456 | € 1.550 | € 1.002.259 |
| Finanzderivate[3] | 3.152 | (18.237) | 0 | (15.085) |
| **Summen** | **€ 7.405** | **€ 978.219** | **€ 1.550** | **€ 987.174** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (0,750 %) | 15.12.2015 | 11.12.2017 | € 3.179 | € (3.178) | (0,40) |
| MYI | (0,080 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 11.806 | (11.804) | (1,48) |
| MYI | (0,060 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 10.930 | (10.929) | (1,37) |
| | | | | | € (25.911) | (3,25) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (555) | € 809 | € 254 |
| BPS | (251) | 249 | (2) |
| BRC | (247) | 322 | 75 |
| CBK | 3.599 | (4.548) | (949) |
| DUB | 21 | (543) | (522) |
| FBF | (440) | 325 | (115) |
| GLM | 48 | 0 | 48 |
| GST | (244) | 359 | 115 |
| HUS | 4.498 | (4.418) | 80 |
| JPM | (1.079) | 1.227 | 148 |
| MSB | (19) | 0 | (19) |
| MYC | (329) | 267 | (62) |
| UAG | 3.908 | (5.358) | (1.450) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31.Dez.2015 | 31.Dez.2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,04 | 105,22 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,13) | 0,33 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,31) | (0,40) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,12 | (1,51) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Income Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 158.200 | € | 160.953 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 512.900 | | 52.111 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 40.800 | | 44.452 |
| **France Treasury Notes** | | | | |
| 2,000 % fällig am 12.07.2015 | | 42.400 | | 42.770 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 34.900 | | 41.832 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.05.2016 | | 39.100 | | 39.921 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | | 32.170 | | 32.153 |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 06.05.2015 | | 31.470 | | 31.478 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 26.400 | | 27.330 |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.03.2015 | | 25.300 | | 25.303 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2016 | | 22.300 | | 23.115 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2016 | | 22.400 | | 22.395 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,079 % fällig am 13.05.2016 | | 20.400 | | 20.386 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | | 18.100 | | 18.086 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 15.400 | | 16.165 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.06.2016 | | 14.900 | | 14.897 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.10.2015 | | 13.000 | | 12.999 |
| **Bank Nederlandse Gemeenten NV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 28.06.2016 | | 10.800 | | 11.247 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 10.500 | | 10.500 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 9.900 | | 10.229 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 158.200 | € | 160.842 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 61.200 | | 66.804 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 50.000 | | 60.306 |
| **France Treasury Notes** | | | | |
| 2,000 % fällig am 12.07.2015 | | 42.400 | | 42.705 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.05.2016 | | 39.100 | | 39.763 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | | 32.170 | | 32.173 |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 06.05.2015 | | 31.470 | | 31.477 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 26.400 | | 27.236 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 255.200 | | 25.949 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.03.2015 | € | 25.300 | | 25.301 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2016 | | 22.300 | | 23.023 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2016 | | 22.400 | | 22.396 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,079 % fällig am 13.05.2016 | | 20.400 | | 20.380 |
| **France Treasury Bills** | | | | |
| (0,011)% fällig am 14.10.2015 | | 19.800 | | 19.808 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | | 18.100 | | 18.090 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.06.2016 | | 14.900 | | 14.897 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.10.2015 | | 13.000 | | 12.999 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| 0,279 % fällig am 27.02.2015 | | 12.840 | | 12.840 |
| **Bank Nederlandse Gemeenten NV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 28.06.2016 | | 10.800 | | 11.241 |
| **BPE Financiaciones S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.02.2017 | | 10.100 | | 10.336 |

(a) Der Euro Income Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Long Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Virgin Media Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2023 | $ | 1.751 | € 1.580 | 0,30 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 200 | 185 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 10.09.2018 | | 500 | 472 | 0,09 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | € | 900 | 958 | 0,18 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 600 | 588 | 0,11 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 21.09.2018 | | 1.300 | 1.312 | 0,25 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 1.100 | 1.129 | 0,21 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 4.000 | 4.200 | 0,80 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 500 | 492 | 0,09 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | | 400 | 354 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.500 | 2.039 | 0,39 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 02.10.2017 | $ | 450 | 446 | 0,08 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2019 | | 900 | 868 | 0,16 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.06.2047 | € | 500 | 487 | 0,09 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | $ | 3.600 | 3.570 | 0,68 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 1.000 | 1.030 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 3.100 | 2.927 | 0,55 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 2.200 | 2.028 | 0,38 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 600 | 576 | 0,11 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.200 | 2.174 | 0,41 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 1.600 | 1.615 | 0,31 |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | | 1.000 | 960 | 0,18 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,700 % fällig am 29.12.2049 | $ | 400 | 376 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,271 % fällig am 23.01.2020 | | 4.500 | 4.150 | 0,79 |
| **KBC Groep NV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.03.2049 | € | 1.400 | 1.403 | 0,27 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.09.2018 | | 100 | 101 | 0,02 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 263 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 700 | 997 | 0,19 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 11.321 | 1.392 | 0,26 |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | € | 4.600 | 4.680 | 0,89 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 100 | 87 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 100 | 88 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 400 | 358 | 0,07 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 15.299 | 1.888 | 0,36 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 8.600 | 1.143 | 0,22 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 42.626 | 5.475 | 1,04 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 10.061 | 1.330 | 0,25 |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.000 | 1.026 | 0,19 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2023 | DKK | 24.700 | 3.462 | 0,66 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 200 | 27 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 16.878 | 2.159 | 0,41 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | € 192 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 500 | 488 | 0,09 |
| **SMFG Preferred Capital GBP 2 Ltd.** | | | | |
| 10,231 % fällig am 29.07.2049 | £ | 100 | 203 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,897 % fällig am 16.01.2018 | $ | 1.000 | 918 | 0,17 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2031 | £ | 986 | 1.306 | 0,25 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 600 | 631 | 0,12 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 300 | 293 | 0,06 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | £ | 400 | 578 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 90 | 120 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | | 900 | 1.267 | 0,24 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 200 | 199 | 0,04 |
| | | | 65.010 | 12,33 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 | $ | 200 | 185 | 0,03 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | € | 2.700 | 2.835 | 0,54 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | $ | 207 | 69 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 391 | 111 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 1.601 | 779 | 0,15 |
| **Fiat Chrysler Finance Europe** | | | | |
| 7,750 % fällig am 17.10.2016 | € | 600 | 630 | 0,12 |
| **Glencore Finance Europe S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 06.04.2016 | CHF | 1.200 | 1.098 | 0,21 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 3.500 | 3.255 | 0,62 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 1.000 | 1.016 | 0,19 |
| **Pizzaexpress Financing 2 PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2021 | £ | 1.500 | 2.093 | 0,40 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 20.05.2035 | $ | 100 | 86 | 0,02 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 1.500 | 1.463 | 0,28 |
| **Telenet Finance V Luxembourg S.C.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.08.2024 | | 400 | 439 | 0,08 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.01.2023 | | 1.170 | 1.231 | 0,23 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 1.400 | 1.222 | 0,23 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.10.2016 | | 200 | 200 | 0,04 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | | 2.700 | 2.700 | 0,51 |
| | | | 19.412 | 3,68 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 05.09.2023 | | 100 | 97 | 0,02 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | $ | 200 | 184 | 0,03 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 1.700 | 1.451 | 0,28 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 800 | 525 | 0,10 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | | 129 | 122 | 0,02 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 500 | 460 | 0,09 |
| | | | 2.839 | 0,54 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 87.261 | 16,55 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | | 41 | 35 | 0,01 |
| 2,351 % fällig am 01.08.2036 | $ | 12 | € 12 | 0,00 |
| | | | 47 | 0,01 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)(b)** | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 4.117 | 3.621 | 0,69 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 2.449 | 2.300 | 0,43 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,190 % fällig am 14.01.2016 (a) | | 1.984 | 1.826 | 0,35 |
| | | | 7.747 | 1,47 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 0,032 % fällig am 15.12.2038 | € | 436 | 401 | 0,08 |
| **Auburn Securities 9 PLC** | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | £ | 1.062 | 1.432 | 0,27 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,617 % fällig am 25.07.2033 | $ | 35 | 32 | 0,01 |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 15.450 | 1.644 | 0,31 |
| **Bluestone Securities PLC** | | | | |
| 0,778 % fällig am 09.06.2044 | £ | 529 | 678 | 0,13 |
| **Casa D'este Finance Srl** | | | | |
| 0,222 % fällig am 15.09.2040 | € | 863 | 841 | 0,16 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 25.07.2033 | $ | 44 | 40 | 0,01 |
| **Darrowby No.2 PLC** | | | | |
| 2,271 % fällig am 20.02.2044 | £ | 776 | 1.063 | 0,20 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,733 % fällig am 15.06.2044 | | 519 | 656 | 0,12 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.12.2044 | | 108 | 141 | 0,03 |
| **F-E Mortgages Srl** | | | | |
| 0,202 % fällig am 15.12.2043 | € | 217 | 215 | 0,04 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 0,896 % fällig am 27.11.2024 | | 97 | 98 | 0,02 |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | | 2.038 | 2.057 | 0,39 |
| 1,496 % fällig am 27.08.2024 | | 185 | 187 | 0,04 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 100 | 87 | 0,02 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | € | 311 | 296 | 0,06 |
| **Infinity Classico** | | | | |
| 0,109 % fällig am 15.02.2024 | | 1.209 | 1.189 | 0,23 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | |
| 0,088 % fällig am 20.11.2022 | | 303 | 297 | 0,06 |
| **Landmark Mortgage Securities No. 3 PLC** | | | | |
| 0,859 % fällig am 17.04.2044 | £ | 1.506 | 1.852 | 0,35 |
| **Landmark Mortgage Securities No.2 PLC** | | | | |
| 0,785 % fällig am 17.06.2039 | | 338 | 413 | 0,08 |
| **Leofric No. 1 PLC** | | | | |
| 2,270 % fällig am 26.05.2050 | | 280 | 384 | 0,07 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,741 % fällig am 01.01.2061 | | 172 | 211 | 0,04 |
| 0,763 % fällig am 01.12.2060 | | 436 | 540 | 0,10 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | € | 1.149 | 1.166 | 0,22 |
| **Mars 2600 Srl** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 1.313 | 1.324 | 0,25 |
| **MINT PLC** | | | | |
| 1,200 % fällig am 22.02.2025 | | 1.500 | 1.498 | 0,28 |
| 1,872 % fällig am 22.02.2025 | £ | 2.700 | 3.662 | 0,69 |
| **Mortgages No.7 PLC** | | | | |
| 1,040 % fällig am 31.10.2038 | | 130 | 168 | 0,03 |
| **Nemus II Arden PLC** | | | | |
| 0,803 % fällig am 15.02.2020 | | 934 | 1.230 | 0,23 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.559 | 1.445 | 0,27 |
| 0,713 % fällig am 15.12.2050 | £ | 643 | 847 | 0,16 |
| **Paragon Mortgages No.7 PLC** | | | | |
| 0,339 % fällig am 15.05.2034 | € | 169 | 156 | 0,03 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC** | | | | |
| 0,775 % fällig am 12.12.2036 | £ | 860 | 1.064 | 0,20 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | £ | 1.274 | € 1.574 | 0,30 |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 1.311 | 1.625 | 0,31 |
| **Residential Mortgage Securities 26 PLC** | | | | |
| 2,823 % fällig am 14.02.2041 | | 565 | 784 | 0,15 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | $ | 84 | 75 | 0,01 |
| **Taurus GMF1 PLC** | | | | |
| 0,958 % fällig am 21.05.2024 | € | 96 | 97 | 0,02 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.09.2043 | $ | 98 | 88 | 0,02 |
| | | | 31.557 | 5,99 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Alpstar CLO 2 PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.05.2024 | € | 2.400 | 2.319 | 0,44 |
| **Avoca CLO V PLC** | | | | |
| 0,428 % fällig am 03.08.2022 | | 165 | 164 | 0,03 |
| **Avoca CLO VI PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 16.01.2023 | | 83 | 83 | 0,02 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,102 % fällig am 20.04.2024 | | 1.829 | 1.826 | 0,35 |
| **Cadogan Square CLO IV BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 24.07.2023 | | 536 | 532 | 0,10 |
| **Celf Loan Partners BV** | | | | |
| 0,429 % fällig am 18.07.2021 | | 1.095 | 1.095 | 0,21 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,512 % fällig am 14.08.2024 | $ | 2.000 | 1.842 | 0,35 |
| **Compartment VCL 22** | | | | |
| 0,422 % fällig am 21.08.2021 | € | 481 | 481 | 0,09 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 27.11.2028 | | 4.500 | 4.500 | 0,85 |
| **Dalradian European Clo IV BV** | | | | |
| 0,547 % fällig am 08.08.2023 | | 669 | 669 | 0,13 |
| **Driver Australia One Trust** | | | | |
| 2,915 % fällig am 21.12.2021 | AUD | 210 | 140 | 0,03 |
| **Duchess VII CLO BV** | | | | |
| 0,111 % fällig am 28.02.2023 | € | 44 | 44 | 0,01 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | | 322 | 321 | 0,06 |
| **Harbourmaster CLO 7 BV** | | | | |
| 0,199 % fällig am 22.09.2022 | | 590 | 589 | 0,11 |
| **Harbourmaster CLO 8 BV** | | | | |
| 0,195 % fällig am 14.12.2022 | | 70 | 70 | 0,01 |
| **Harbourmaster CLO 9 BV** | | | | |
| 0,167 % fällig am 08.05.2023 | | 363 | 362 | 0,07 |
| **Highlander Euro CDO BV** | | | | |
| 0,488 % fällig am 06.09.2022 | | 978 | 975 | 0,19 |
| **Highlander Euro CDO III BV** | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | € | 2.710 | € 2.651 | 0,50 |
| **IM Grupo Banco Popular FTPYME I FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2039 | | 1.238 | 1.228 | 0,23 |
| **Jubilee CDO VII BV** | | | | |
| 0,113 % fällig am 20.11.2022 | | 57 | 57 | 0,01 |
| **Mercator CLO II PLC** | | | | |
| 0,149 % fällig am 18.02.2024 | | 96 | 95 | 0,02 |
| **Panther CDO IV BV** | | | | |
| 0,304 % fällig am 20.03.2084 | | 1.817 | 1.754 | 0,33 |
| **Penta CLO 1 S.A.** | | | | |
| 0,172 % fällig am 04.06.2024 | | 403 | 400 | 0,08 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,132 % fällig am 15.12.2023 | | 285 | 275 | 0,05 |
| 0,142 % fällig am 17.06.2024 | | 1.045 | 998 | 0,19 |
| 0,422 % fällig am 15.12.2033 | | 1.548 | 1.337 | 0,25 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 498 | 499 | 0,09 |
| **Wood Street CLO III BV** | | | | |
| 0,271 % fällig am 27.08.2022 | | 100 | 99 | 0,02 |
| | | | 25.405 | 4,82 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 | | 2.000 | 2.025 | 0,38 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 2.900 | 3.068 | 0,58 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 600 | 648 | 0,12 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 1,826 % fällig am 30.04.2025 | | 150 | 148 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 21.05.2024 | | 500 | 588 | 0,11 |
| 4,300 % fällig am 15.09.2026 | | 2.100 | 2.518 | 0,48 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 10 | 2 | 0,00 |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 27.000 | 1.009 | 0,19 |
| 6,950 % fällig am 26.01.2016 | | 32.000 | 1.192 | 0,23 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (1,120 %) fällig am 19.02.2016 | | 28.000 | 1.037 | 0,20 |
| (0,490 %) fällig am 12.02.2016 | | 5.000 | 185 | 0,03 |
| (0,121 %) fällig am 02.09.2016 | | 154.000 | 5.705 | 1,08 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.04.2030 | € | 300 | 409 | 0,08 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 1,625 % fällig am 17.11.2036 | | 1.600 | 1.597 | 0,30 |
| 1,850 % fällig am 01.12.2055 | | 1.500 | 1.447 | 0,27 |
| **FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico** | | | | |
| 0,850 % fällig am 17.09.2019 | | 1.500 | 1.513 | 0,29 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.05.2030 | | 35.600 | 40.334 | 7,65 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (c) | | 62.600 | 79.605 | 15,10 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2038 | € | 30.800 | € 43.117 | 8,18 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | | 19.980 | 29.877 | 5,67 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 14.160 | 21.432 | 4,07 |
| 4,750 % fällig am 25.04.2035 | | 19.000 | 28.439 | 5,40 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 (b) | | 2.000 | 2.074 | 0,39 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 09.06.2022 | MXN | 40 | 2 | 0,00 |
| 7,750 % fällig am 29.05.2031 | | 15.446 | 905 | 0,17 |
| 10,000 % fällig am 05.12.2024 | | 10 | 1 | 0,00 |
| **Netherlands Government Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2033 | € | 9.800 | 11.544 | 2,19 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2047 | | 9.600 | 12.309 | 2,34 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,500 % fällig am 10.09.2021 | $ | 8.900 | 8.197 | 1,55 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.07.2044 (c) | € | 10.000 | 12.469 | 2,37 |
| 2,500 % fällig am 15.08.2046 (c)(d) | | 9.100 | 11.363 | 2,16 |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 (c)(d) | | 1.600 | 2.517 | 0,48 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2034 (d) | | 26 | 41 | 0,01 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 28.07.2025 | | 3.200 | 3.350 | 0,64 |
| 2,250 % fällig am 25.03.2022 (e) | | 2.600 | 2.793 | 0,53 |
| 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 1.700 | 1.865 | 0,35 |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 900 | 873 | 0,17 |
| 5,125 % fällig am 30.03.2026 | € | 1.400 | 1.851 | 0,35 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 500 | 509 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 2.900 | 2.990 | 0,57 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 1.000 | 1.050 | 0,20 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 1,950 % fällig am 30.07.2030 | € | 1.700 | 1.627 | 0,31 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 16.100 | 17.578 | 3,33 |
| | | | 361.803 | 68,65 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source** | | | |
| UCITS ETF (f) | 8.800 | 895 | 0,17 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (f)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term** | | | |
| Floating NAV Fund | 40.132 | 370 | 0,07 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 516.665** | **98,03** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 172 | € 253 | 0,05 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 464 | (980) | (0,19) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 941 | (3.124) | (0,59) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 1.375 | 193 | 0,04 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 127 | (27) | (0,01) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 49 | (42) | (0,01) |
| | | | | € (3.727) | (0,71) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 98,875 | 11.03.2016 | 797 | € 105 | € 169 | 0,03 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 160,500 | 22.01.2016 | 49 | € (19) | € (6) | 0,00 |
| Put - Euro-Bobl 5-Year Note February Futures | 131,500 | 22.01.2016 | 195 | (100) | (169) | (0,03) |
| Put - Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | 111,500 | 19.02.2016 | 582 | (75) | (43) | (0,01) |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 797 | (70) | (7) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 797 | (26) | (51) | (0,01) |
| | | | | € (290) | € (276) | (0,05) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ (3.834)** | **(0,73)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | (5,000 %) | 20.12.2020 | € 29.900 | € (172) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | $ 18.000 | € 31 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 12.500 | 56 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | £ 4.000 | (122) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 21.09.2017 | JPY 17.560.000 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,750 % | 20.12.2024 | 4.117.500 | (467) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 19.09.2025 | 1.310.000 | (173) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2044 | 1.380.000 | 543 | 0,10 |
| | | | | | € (113) | (0,02) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (285)** | **(0,05)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BPS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,110 % | 22.03.2016 | € 8.100 | € 139 | € 23 | 0,00 |
| Call - OTC 20-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,200 % | 01.12.2016 | 10.500 | 277 | 188 | 0,04 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,110 % | 22.03.2016 | 400 | 6 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 2,620 % | 03.10.2016 | £ 7.400 | 269 | 210 | 0,04 |
| | | | | | | | € 691 | € 422 | 0,08 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | HUS | $ 1,050 | 09.02.2016 | € 2.600 | € (10) | € (7) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNY 6,600 | 05.02.2016 | $ 2.050 | (21) | (12) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 6,600 | 05.02.2016 | 1.830 | (18) | (11) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | CBK | 7,000 | 19.09.2016 | 5.800 | (76) | (72) | (0,02) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BOA | JPY 80,000 | 28.02.2019 | 900 | (35) | (5) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | FBF | 80,000 | 28.02.2019 | 600 | (23) | (3) | 0,00 |
| | | | | | € (183) | € (110) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BPS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,990 % | 22.03.2016 | € 8.100 | € (157) | € (39) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 2.600 | (20) | (51) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GST | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,493 % | 01.09.2016 | 6.100 | (174) | (239) | (0,05) |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,990 % | 22.03.2016 | 400 | (7) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.02.2016 | £ 900 | (21) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 6.200 | (45) | (18) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 6.200 | (31) | (36) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 01.12.2016 | 5.800 | (300) | (177) | (0,03) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 3.300 | (23) | (3) | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.02.2016 | 1.400 | (33) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 03.10.2016 | 35.300 | (270) | (222) | (0,04) |
| | | | | | | | € (1.081) | € (789) | (0,15) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | $ 400 | € (61) | € (49) | € (12) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 3.500 | (532) | (420) | (112) | (0,10) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 200 | (30) | (24) | (6) | (0,01) |
| Glencore Finance Europe S.A. | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | € 1.700 | (84) | (73) | (11) | (0,02) |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | $ 2.000 | (45) | (48) | 3 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 1.600 | (135) | (154) | 19 | (0,03) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | € 200 | (11) | (3) | (8) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 500 | (28) | (3) | (25) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 600 | (34) | (2) | (32) | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 300 | (7) | (10) | 3 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 800 | (20) | (28) | 8 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 500 | (12) | (17) | 5 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.03.2017 | FBF | 5.800 | (14) | 76 | (90) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 800 | (19) | (41) | 22 | 0,00 |
| | | | | | € (1.032) | € (796) | € (236) | (0,20) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | JPY 284.000 | € 28 | € 23 | € 5 | 0,01 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 698.000 | 68 | 55 | 13 | 0,01 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 385.000 | 37 | 31 | 6 | 0,01 |
| | | | | | € 133 | € 109 | € 24 | 0,03 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 1.085 | $ | 287 | DUB | € 15 | € (3) | € 12 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 277 | BRL | 1.085 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.950 | CNH | 32.301 | HUS | 26 | (75) | (49) | (0,01) |
| 01/2016 | CNY | 14.940 | $ | 2.300 | HUS | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | CZK | 34.305 | € | 1.275 | HUS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 24.724 | DKK | 184.513 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 115.445 | € | 15.484 | MSB | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | | 69.730 | | 9.352 | UAG | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.257 | JPY | 430.500 | CBK | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 430.500 | € | 3.300 | UAG | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.573 | KRW | 1.827.535 | BOA | 30 | (47) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 3.493.255 | $ | 3.004 | FBF | 91 | (60) | 31 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.634 | MYR | 6.892 | BOA | 17 | (50) | (33) | (0,01) |
| 01/2016 | MYR | 12.904 | $ | 2.980 | BPS | 97 | (107) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 4.234 | € | 2.895 | BPS | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| 02/2016 | BRL | 1.085 | $ | 274 | DUB | 4 | (1) | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 28.143 | € | 1.050 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.011 | | 186 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 8.174 | DKK | 60.920 | GLM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.306 | € | 3.026 | BOA | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.999 | £ | 1.450 | BOA | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| 02/2016 | | 4.761 | $ | 5.185 | BOA | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 954 | € | 1.353 | BPS | 60 | 0 | 60 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | JPY | 430.500 | € | 3.256 | CBK | € 0 | € (38) | € (38) | (0,01) |
| 02/2016 | € | 556 | $ | 600 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.498 | € | 1.369 | CBK | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 5.792 | $ | 6.310 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.126 | € | 2.001 | GLM | 46 | 0 | 46 | 0,01 |
| 02/2016 | NOK | 17.335 | | 1.868 | GLM | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 605 | £ | 442 | HUS | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 15.537 | € | 14.293 | JPM | 96 | (92) | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 20.971 | | 29.520 | JPM | 1.090 | 0 | 1.090 | 0,21 |
| 02/2016 | SEK | 16.470 | | 1.769 | JPM | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.671 | JPY | 223.700 | JPM | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| 02/2016 | NZD | 4.364 | € | 2.725 | JPM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.860 | NOK | 17.120 | MSB | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 566 | € | 520 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 214 | £ | 150 | MSB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 38.527 | € | 35.669 | NAB | 236 | 0 | 236 | 0,05 |
| 02/2016 | | 423 | | 388 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 2.995 | $ | 3.247 | UAG | 12 | (21) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 2.043 | | 1.451 | SCX | 42 | (30) | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 51.844 | | 1.442 | FBF | 43 | (40) | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 46.351 | | 1.419 | GLM | 48 | (35) | 13 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 18.382 | | 1.072 | GLM | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 847 | | 215 | GLM | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | CHF | 1.202 | € | 1.112 | HUS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 04/2016 | DKK | 184.513 | | 24.735 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 09/2016 | CZK | 65.098 | | 2.425 | SOG | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 09/2016 | | 89.089 | | 3.314 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 56.602 | $ | 8.693 | CBK | 304 | (7) | 297 | 0,06 |
| 10/2016 | $ | 3.648 | CNH | 23.668 | UAG | 79 | (215) | (136) | (0,03) |
| 10/2016 | CZK | 27.272 | € | 1.025 | DUB | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 12.340 | | 1.656 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | € | 1.356 | DKK | 10.098 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 17.100 | € | 2.295 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | € | 830 | DKK | 6.170 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 10/2016 | | 2.719 | | 20.229 | HUS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 4.548 | € | 610 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | € | 707 | DKK | 5.260 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 10.764 | € | 1.445 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € 2.670 | € (1.047) | € 1.623 | 0,31 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 247** | **0,05** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ | 800 | € 737 | 0,14 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **€ 737** | **0,14** |
| **Summe Anlagen** | | | **€ 513.530** | **97,44** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 379 | € 515 | 0,10 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 11 | 10 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 10 | 7 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 33.339 | 255 | 0,05 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 307 | 282 | 0,05 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 1.135 | 124 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 329 | 3 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 13 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 96 | 88 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 59 | 4 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 92 | € 85 | 0,02 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 6 | 4 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 4 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 29 | 19 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2.024 | 2.024 | 0,39 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 14.042 | 107 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 120 | 162 | 0,03 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 3.705** | **0,70** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ 9.799** | **1,86** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 527.034** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 7.747 und Barmittel in Höhe von EUR 3.279 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.899 und Barmittel in Höhe von EUR 1.445 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 1.061 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 2.685 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(f) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 1.265 | € 515.400 | € 0 | € 516.665 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 737 | 0 | 737 |
| Finanzderivate[3] | (3.834) | (38) | 0 | (3.872) |
| **Summen** | **€ (2.569)** | **€ 516.099** | **€ 0** | **€ 513.530** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 25.469 | € 617.986 | € 0 | € 643.455 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 5.300 | 0 | 5.300 |
| Finanzderivate[3] | 7.609 | (2.176) | 0 | 5.433 |
| **Summen** | **€ 33.078** | **€ 621.110** | **€ 0** | **€ 654.188** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,470 %) | 06.11.2015 | 05.11.2017 | € 2.725 | € (2.723) | (0,52) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (103) | € 0 | € (103) |
| BPS | 130 | 0 | 130 |
| BRC | (69) | 0 | (69) |
| CBK | 124 | 0 | 124 |
| DUB | 35 | (140) | (105) |
| FBF | 17 | 0 | 17 |
| GLM | 129 | 0 | 129 |
| GST | (334) | 436 | 102 |
| HUS | (742) | 622 | (120) |
| JPM | 1.013 | (1.258) | (245) |
| MSB | (79) | 0 | (79) |
| NAB | 236 | (430) | (194) |
| SCX | 12 | 0 | 12 |
| SOG | 6 | 0 | 6 |
| UAG | (128) | 3 | (125) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,03 | 99,81 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,73) | 1,18 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,05) | 0,43 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,05 | (0,77) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,14 | 0,82 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Long Average Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.07.2044 | € | 43.500 | € | 63.240 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 46.800 | | 63.094 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2038 | | 37.200 | | 55.452 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.04.2035 | | 27.900 | | 45.372 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.05.2030 | | 36.600 | | 41.708 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 390.500 | | 39.755 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 25.200 | | 27.663 |
| **Portugal Obrigacoes do Tesouro OT** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2025 | | 23.500 | | 24.167 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 13.700 | | 24.106 |
| **Netherlands Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2047 | | 16.900 | | 23.703 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.11.2015 | | 23.700 | | 23.666 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 140.200 | | 19.123 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 17.500 | | 17.882 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 1,375 % fällig am 30.04.2020 | $ | 19.300 | | 16.790 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | € | 10.100 | | 16.676 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 2,350 % fällig am 29.07.2044 | | 11.000 | | 15.154 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027 | | 12.300 | | 14.915 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.08.2046 | | 9.900 | | 13.044 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 23.01.2017 | | 9.500 | | 10.294 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2016 | | 9.320 | | 9.833 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 628.900 | € | 64.069 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **France Government Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | € | 37.900 | | 53.937 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.07.2044 | | 33.500 | | 46.582 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.10.2032 | | 27.900 | | 46.415 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 19.700 | | 33.929 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.04.2035 | | 20.900 | | 33.224 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.04.2029 | | 21.200 | | 33.154 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | | 17.800 | | 31.318 |
| **Portugal Obrigacoes do Tesouro OT** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2025 | | 23.500 | | 25.660 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 2,350 % fällig am 29.07.2044 | | 21.000 | | 24.720 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.11.2015 | | 23.700 | | 23.661 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 140.200 | | 19.049 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 21.428 | | 18.576 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | € | 12.100 | | 18.551 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | | 17.500 | | 17.879 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 1,375 % fällig am 30.04.2020 | $ | 19.300 | | 17.091 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 5,500 % fällig am 04.01.2031 | € | 9.600 | | 16.541 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.07.2034 | | 9.300 | | 15.969 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.10.2027 | | 12.300 | | 15.142 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 31.01.2020 | | 13.500 | | 13.899 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 9.800 | | 11.786 |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 43.400 | | 10.953 |

(a) Der Euro Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Low Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 29.09.2017 | $ | 400 | € 369 | 0,55 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 5,000 % fällig am 09.02.2018 | € | 1.500 | 1.636 | 2,44 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 | | 500 | 73 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,709 % fällig am 28.03.2018 | | 1.000 | 995 | 1,49 |
| **Cajas Rurales Unidas SCC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.11.2018 | | 700 | 762 | 1,14 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | $ | 800 | 793 | 1,18 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 800 | 814 | 1,22 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 700 | 645 | 0,96 |
| **Erste Europaische Pfandbrief- und Kommunalkreditbank AG in Luxemburg S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 23.06.2016 | CHF | 2.900 | 2.681 | 4,00 |
| **GELF Bond Issuer I S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 03.04.2018 | € | 700 | 732 | 1,09 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,591 % fällig am 29.05.2020 | | 1.100 | 1.095 | 1,63 |
| **Heta Asset Resolution AG** | | | | |
| 2,500 % fällig am 13.06.2016 | CHF | 700 | 641 | 0,96 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.05.2023 | € | 700 | 780 | 1,16 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.11.2017 | | 1.000 | 1.067 | 1,59 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 600 | 603 | 0,90 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,386 % fällig am 28.04.2017 | € | 1.200 | 1.198 | 1,79 |
| **Leveraged Finance Europe Capital II BV** | | | | |
| 0,740 % fällig am 02.03.2020 | | 305 | 305 | 0,46 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 0,432 % fällig am 02.11.2018 | | 1.000 | 1.001 | 1,50 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2018 | DKK | 8.000 | 1.122 | 1,68 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2018 | | 8.000 | 1.093 | 1,63 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | $ | 350 | 328 | 0,49 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 700 | 674 | 1,01 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 0,902 % fällig am 10.04.2017 | € | 500 | 503 | 0,75 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 0,822 % fällig am 15.12.2017 | | 300 | 301 | 0,45 |
| | | | 20.211 | 30,18 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,720 % fällig am 31.07.2018 | £ | 100 | 141 | 0,21 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.12.2019 | $ | 400 | 384 | 0,57 |
| **CMA CGM S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.12.2018 | € | 100 | 98 | 0,15 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.05.2018 | | 600 | 616 | 0,92 |
| **Fiat Chrysler Finance Europe** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.03.2018 | | 400 | 436 | 0,65 |
| **Glencore Finance Europe S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 22.03.2017 (a) | | 700 | 689 | 1,03 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2019 | $ | 400 | € 372 | 0,56 |
| **Hella KGaA Hueck & Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2017 | € | 300 | 304 | 0,45 |
| **HOCHTIEF AG** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.03.2017 | | 700 | 737 | 1,10 |
| **Holcim GB Finance Ltd.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 24.04.2017 | £ | 400 | 592 | 0,88 |
| **Indesit Co. SpA** | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.04.2018 | € | 600 | 646 | 0,97 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.06.2017 | $ | 800 | 759 | 1,13 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.04.2017 | € | 800 | 853 | 1,27 |
| **National Express Group PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 13.01.2017 | £ | 500 | 710 | 1,06 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | $ | 400 | 366 | 0,55 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2019 | € | 500 | 506 | 0,76 |
| **Sky PLC** | | | | |
| 0,618 % fällig am 01.04.2020 | | 800 | 799 | 1,19 |
| **Solvay S.A.** | | | | |
| 0,706 % fällig am 01.12.2017 | | 200 | 201 | 0,30 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 5,375 % fällig am 02.02.2018 | £ | 600 | 867 | 1,29 |
| 5,811 % fällig am 05.09.2017 | € | 200 | 218 | 0,33 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | $ | 300 | 261 | 0,39 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | € | 200 | 192 | 0,29 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 3,250 % fällig am 10.05.2018 | | 900 | 940 | 1,40 |
| **Wendel S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 20.04.2018 | | 800 | 911 | 1,36 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 26.04.2019 | | 400 | 401 | 0,60 |
| | | | 12.999 | 19,41 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,462 % fällig am 04.06.2019 | | 900 | 901 | 1,35 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | £ | 500 | 718 | 1,07 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 7,500 % fällig am 04.02.2019 | € | 700 | 844 | 1,26 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | | 800 | 850 | 1,27 |
| | | | 3.313 | 4,95 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 36.523 | 54,54 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 5.150 | 548 | 0,82 |
| **Casa D'este Finance Srl** | | | | |
| 0,222 % fällig am 15.09.2040 | € | 203 | 198 | 0,30 |
| **Claris Finance Srl** | | | | |
| 0,159 % fällig am 20.06.2055 | | 81 | 80 | 0,12 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | £ | 201 | 264 | 0,39 |
| **DECO 8-UK Conduit 2 PLC** | | | | |
| 0,759 % fällig am 27.04.2018 | | 369 | 496 | 0,74 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 0,896 % fällig am 27.11.2024 | € | 583 | 587 | 0,88 |
| **Leek Finance Number Seventeen PLC** | | | | |
| 0,147 % fällig am 21.12.2037 | | 27 | 29 | 0,04 |
| | | | 2.202 | 3,29 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ayt FTPYME II FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.10.2032 | € | 18 | € 18 | 0,02 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | | 12 | 12 | 0,02 |
| **Euro-Galaxy II CLO BV** | | | | |
| 0,238 % fällig am 29.10.2022 | | 542 | 534 | 0,80 |
| **Gamma-Sociedade Titularizacao de Creditos S.A.** | | | | |
| 1,149 % fällig am 28.01.2044 | | 581 | 580 | 0,87 |
| **Highlander Euro CDO III BV** | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | | 562 | 550 | 0,82 |
| **IM Grupo Banco Popular FTPYME I FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2039 | | 439 | 436 | 0,65 |
| **Quarzo Cqs Srl** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.11.2030 | | 503 | 501 | 0,75 |
| **Regent's Park CDO BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 26.01.2023 | | 167 | 166 | 0,25 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,616 % fällig am 27.11.2031 | | 182 | 182 | 0,27 |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | | 1.109 | 1.103 | 1,65 |
| 0,649 % fällig am 27.12.2032 | | 400 | 401 | 0,60 |
| | | | 4.483 | 6,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Andalusia** | | | | |
| 4,850 % fällig am 17.03.2020 | | 600 | 696 | 1,04 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 700 | 741 | 1,10 |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.06.2019 (a) | | 1.700 | 1.833 | 2,74 |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 90.000 | 3.362 | 5,02 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (1,120 %) fällig am 19.02.2016 | | 34.000 | 1.259 | 1,88 |
| (0,490 %) fällig am 12.02.2016 | | 27.000 | 999 | 1,49 |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | | 15.000 | 556 | 0,83 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 1,250 % fällig am 05.02.2018 | € | 600 | 618 | 0,92 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2018 | | 600 | 672 | 1,00 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 0,050 % fällig am 17.12.2018 | | 900 | 904 | 1,35 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| (0,032 %) fällig am 14.12.2016 | | 200 | 200 | 0,30 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.05.2018 | | 1.700 | 1.707 | 2,55 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 4,100 % fällig am 30.07.2018 (a) | | 6.100 | 6.715 | 10,03 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 6,131 % fällig am 03.04.2018 | | 100 | 113 | 0,17 |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | | 400 | 453 | 0,68 |
| | | | 20.828 | 31,10 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (b)** | | 54.700 | 5.564 | 8,31 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€ 69.600** | **103,94** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor Interest Rate March Futures | Long | 03/2017 | 70 | € (15) | (0,02) |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 22 | 4 | 0,00 |
| | | | | € (11) | (0,02) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (11)** | **(0,02)** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 7.300 | € 25 | 0,04 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ 25** | **0,04** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 7,000 | 13.09.2016 | $ 2.370 | € (28) | € (30) | (0,04) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.03.2017 | CBK | € 200 | € 0 | € 3 | € (3) | 0,00 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | DKK | 33.261 | € | 4.471 | BOA | € 14 | € 0 | € 14 | 0,02 |
| 01/2016 | | 53.170 | | 7.145 | BPS | 20 | 0 | 20 | 0,03 |
| 01/2016 | € | 5.195 | DKK | 38.766 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.438 | | 33.105 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.952 | | 14.560 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 5.547 | € | 5.143 | JPM | 38 | 0 | 38 | 0,06 |
| 02/2016 | € | 1.766 | CHF | 1.916 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 27.057 | € | 1.006 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | | 34.173 | | 1.276 | UAG | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 02/2016 | DKK | 70.815 | | 9.502 | GLM | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| 02/2016 | € | 393 | $ | 431 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | | 294 | £ | 216 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 460 | € | 425 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 5.924 | $ | 6.315 | CBK | 0 | (116) | (116) | (0,17) |
| 02/2016 | | 218 | £ | 153 | CBK | 0 | (11) | (11) | (0,02) |
| 02/2016 | | 385 | $ | 419 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 10 | € | 9 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.804 | £ | 3.370 | FBF | 0 | (236) | (236) | (0,35) |
| 02/2016 | $ | 102 | € | 95 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.140 | | 2.015 | JPM | 47 | 0 | 47 | 0,07 |
| 02/2016 | € | 4.351 | £ | 3.071 | JPM | 0 | (188) | (188) | (0,28) |
| 02/2016 | | 214 | $ | 227 | JPM | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 9.673 | € | 13.596 | JPM | 483 | 0 | 483 | 0,72 |
| 02/2016 | SEK | 5.495 | | 590 | JPM | 0 | (10) | (10) | (0,02) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Low Duration Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € | 672 | $ | 719 | MSB | € 0 | € (10) | € (10) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 21.899 | € | 20.275 | NAB | 134 | 0 | 134 | 0,20 |
| 02/2016 | € | 41 | SEK | 380 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.454 | $ | 6.917 | SOG | 0 | (92) | (92) | (0,14) |
| 02/2016 | $ | 1.116 | € | 1.047 | SOG | 21 | 0 | 21 | 0,03 |
| 02/2016 | | 536 | | 495 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 6.490 | $ | 6.963 | UAG | 3 | (89) | (86) | (0,13) |
| 03/2016 | MXN | 110 | | 6 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | € | 11.362 | DKK | 84.615 | CBK | 0 | (20) | (20) | (0,03) |
| 04/2016 | DKK | 30.061 | € | 4.030 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 09/2016 | CZK | 15.023 | | 556 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 15.252 | $ | 2.343 | CBK | 82 | (2) | 80 | 0,12 |
| 10/2016 | $ | 586 | CNH | 3.864 | HUS | 33 | (46) | (13) | (0,02) |
| 10/2016 | | 594 | | 3.915 | MSB | 32 | (46) | (14) | (0,02) |
| 10/2016 | CZK | 58.590 | € | 2.202 | DUB | 22 | 0 | 22 | 0,03 |
| 10/2016 | | 32.334 | | 1.213 | JPM | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | | | | | | € 976 | € (881) | € 95 | 0,14 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 65** | **0,10** |
| **Summe Anlagen** | **€ 69.679** | **104,06** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | € 1 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 6 | 4 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 70 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 20 | 19 | 0,03 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,01 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 0 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 5 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,01 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 4 | 3 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 634 | 634 | 0,95 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 29 | 0 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 676** | **1,01** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ (3.395)** | **(5,07)** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 66.960** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 3.953 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

(b) Der Euro Low Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(c) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von EUR 258 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.

(d) Barmittel in Höhe von EUR 100 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(e) Barmittel in Höhe von EUR 148 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 5.564 | € 64.036 | € 0 | € 69.600 |
| Finanzderivate[3] | (11) | 90 | 0 | 79 |
| **Summen** | **€ 5.553** | **€ 64.126** | **€ 0** | **€ 69.679** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 10.444 | € 220.145 | € 120 | € 230.709 |
| Finanzderivate[3] | 62 | (1.000) | 0 | (938) |
| **Summen** | **€ 10.506** | **€ 219.145** | **€ 120** | **€ 229.771** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(g) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional AUD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 1.693 | AUD 2.500 | BOA | € 0 | € (18) | € (18) | (0,03) |
| 01/2016 | AUD 2.505 | € 1.672 | BOA | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | 60 | 40 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 1.705 | AUD 2.519 | CBK | 0 | (18) | (18) | (0,02) |
| 01/2016 | 1.692 | 2.500 | DUB | 0 | (18) | (18) | (0,03) |
| 01/2016 | 1.693 | 2.500 | GLM | 0 | (18) | (18) | (0,03) |
| 01/2016 | AUD 2.505 | € 1.672 | HUS | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 01/2016 | 2.505 | 1.672 | JPM | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | 2.505 | 1.672 | SCX | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | € 1.669 | AUD 2.505 | BOA | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 02/2016 | 1.669 | 2.505 | HUS | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 02/2016 | 1.668 | 2.505 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 02/2016 | 1.668 | 2.505 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | | | | € 22 | € (95) | € (73) | (0,11) |

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CFR | (1,000 %) | 11.12.2015 | 10.12.2017 | € 688 | € (688) | (1,03) |
| CFR | (0,400 %) | 18.12.2015 | 24.11.2017 | 1.866 | (1.865) | (2,78) |
| MYI | (0,050 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 1.451 | (1.451) | (2,17) |
| | | | | | € (4.004) | (5,98) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (1) | € 0 | € (1) |
| BPS | 19 | 0 | 19 |
| CBK | (83) | 0 | (83) |
| DUB | 5 | (55) | (50) |
| FBF | (236) | 258 | 22 |
| GLM | (5) | 0 | (5) |
| HUS | (13) | 0 | (13) |
| JPM | 372 | (267) | 105 |
| MSB | (24) | 0 | (24) |
| NAB | 134 | (350) | (216) |
| SCX | (35) | 0 | (35) |
| SOG | (71) | 0 | (71) |
| UAG | (70) | 0 | (70) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Low Duration Fund (Forts.)

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 103,94 | 98,95 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,02) | 0,03 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,04 | 0,00 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,10 | (0,43) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Low Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Spain Government Bond** 4,100 % fällig am 30.07.2018 | € | 16.700 | € 18.499 |
| **Spain Government Bond** 0,250 % fällig am 30.04.2018 | | 15.400 | 15.225 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 3,750 % fällig am 01.05.2021 | | 11.000 | 12.890 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 125.600 | 12.768 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 4,250 % fällig am 01.02.2019 | € | 10.800 | 12.081 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 1,500 % fällig am 22.01.2020 | | 11.300 | 12.070 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,250 % fällig am 15.05.2018 | | 10.900 | 10.874 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,750 % fällig am 01.12.2015 | | 10.400 | 10.606 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** 0,000 % fällig am 14.07.2016 | | 10.600 | 10.595 |
| **Spain Government Bond** 1,400 % fällig am 31.01.2020 | | 8.400 | 8.691 |
| **FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico** 0,850 % fällig am 17.09.2019 | | 7.500 | 7.494 |
| **BMW US Capital LLC** 0,149 % fällig am 20.04.2018 | | 7.300 | 7.300 |
| **Realkredit Danmark** 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 51.000 | 6.983 |
| **Spain Government Bond** 3,250 % fällig am 30.04.2016 | € | 4.800 | 4.937 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,550 % fällig am 22.10.2016 | | 4.491 | 4.635 |
| **Nykredit Realkredit** 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 31.900 | 4.370 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,591 % fällig am 29.05.2020 | € | 4.100 | 4.099 |
| **Cyprus Government International Bond** 4,750 % fällig am 25.06.2019 | | 3.800 | 4.054 |
| **Spain Government Bond** 4,000 % fällig am 30.04.2020 | | 3.600 | 4.045 |
| **Spain Government Bond** 2,750 % fällig am 30.04.2019 | | 3.700 | 3.954 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Spain Government Bond** 4,100 % fällig am 30.07.2018 | € | 20.600 | € 22.760 |
| **Spain Government Bond** 0,250 % fällig am 30.04.2018 | | 21.600 | 21.624 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 173.600 | 17.654 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Slovenia Government Bond** 4,000 % fällig am 22.03.2018 | € | 13.700 | 15.003 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 4,250 % fällig am 01.02.2019 | | 11.400 | 12.844 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 3,750 % fällig am 01.05.2021 | | 11.000 | 12.358 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 1,500 % fällig am 22.01.2020 | | 11.300 | 12.148 |
| **Spain Government Bond** 1,400 % fällig am 31.01.2020 | | 11.000 | 11.223 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,750 % fällig am 01.12.2015 | | 10.400 | 10.602 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** 0,000 % fällig am 14.07.2016 | | 10.600 | 10.597 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,250 % fällig am 15.05.2018 | | 9.200 | 9.195 |
| **FADE - Fondo de Amortizacion del Deficit Electrico** 0,850 % fällig am 17.09.2019 | | 7.500 | 7.488 |
| **BMW US Capital LLC** 0,149 % fällig am 20.04.2018 | | 7.300 | 7.292 |
| **Spain Government Bond** 0,500 % fällig am 31.10.2017 | | 7.100 | 7.143 |
| **Realkredit Danmark** 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 51.000 | 6.923 |
| **Depfa ACS Bank** 3,875 % fällig am 14.11.2016 | € | 6.400 | 6.731 |
| **Slovenia Government International Bond** 3,500 % fällig am 23.03.2017 | | 5.743 | 6.110 |
| **Bank of America Corp.** 0,709 % fällig am 28.03.2018 | | 5.700 | 5.662 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 0,591 % fällig am 29.05.2020 | | 5.600 | 5.579 |
| **Gas Natural Capital Markets S.A.** 4,125 % fällig am 26.01.2018 | | 5.100 | 5.527 |

(a) Der Euro Low Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | $ | 200 | € | 197 | 0,70 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | | 200 | | 190 | 0,67 |
| **KBC Bank NV** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 200 | | 201 | 0,71 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | | 186 | 0,66 |
| | | | | 774 | 2,74 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | | 774 | 2,74 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.03.2036 | | 14 | | 13 | 0,04 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 (a) | | 556 | | 447 | 1,58 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) | DKK | 3.856 | € | 532 | 1,88 |
| **France Government Bond (a)** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 | € | 404 | | 420 | 1,49 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (b) | | 981 | | 1.007 | 3,56 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 641 | | 674 | 2,38 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 | | 1.054 | | 1.142 | 4,04 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 | | 1.086 | | 1.212 | 4,29 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 | | 608 | | 815 | 2,88 |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 | | 974 | | 1.192 | 4,22 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 | | 494 | | 588 | 2,08 |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 | | 2.493 | | 2.850 | 10,08 |
| 3,400 % fällig am 25.07.2029 | | 276 | | 403 | 1,43 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (a)** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 | | 1.570 | | 1.628 | 5,76 |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 2.713 | | 2.863 | 10,13 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 900 | | 1.004 | 3,55 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 532 | | 583 | 2,06 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 1.952 | | 2.255 | 7,98 |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 435 | | 548 | 1,94 |
| 3,100 % fällig am 15.09.2026 | | 1.593 | | 1.987 | 7,03 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (a) | MXN | 10.567 | | 620 | 2,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **New Zealand Government Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2035 (a) | NZD | 400 | € 251 | 0,89 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 (c) | € | 716 | 755 | 2,67 |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 | | 275 | 279 | 0,99 |
| 0,500 % fällig am 15.04.2030 (c) | | 415 | 455 | 1,61 |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (c)(d) | | 1.607 | 1.648 | 5,83 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,550 % fällig am 30.11.2019 | | 401 | 412 | 1,46 |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 | | 300 | 295 | 1,04 |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 | | 201 | 220 | 0,78 |
| **Sweden Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 (a) | SEK | 1.600 | 178 | 0,63 |
| | | | 26.816 | 94,87 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€ 28.050** | **99,23** |

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | | Aufgeld | | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | | | |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | € | 158,500 | 19.02.2016 | 3 | € | (3) | € | (5) | (0,02) |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | | 159,000 | 19.02.2016 | 3 | | (4) | | (6) | (0,02) |
| | | | | | € | (7) | € | (11) | (0,04) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | | | **€** | **(11)** | **(0,04)** |

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

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | $ 800 | € (33) | (0,11) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | £ 200 | 12 | 0,04 |
| | | | | | € (21) | (0,07) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (21)** | **(0,07)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 20-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,200 % | 01.12.2016 | € 200 | € 5 | € 4 | 0,01 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 01.12.2016 | £ 100 | € (5) | € (3) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.02.2016 | 100 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | € (8) | € (3) | (0,01) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | (0,063)% | 15.08.2016 | UAG | € 100 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,270 % | 15.08.2016 | BRC | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,305 % | 15.09.2016 | CBK | 400 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,320 % | 15.09.2016 | JPM | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Germany CPI 2005-1CC | 2,100 % | 15.10.2017 | BRC | 5.300 | (313) | (3) | (310) | (1,11) |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,275 % | 15.11.2030 | CBK | £ 500 | 1 | (2) | 3 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,338 % | 15.11.2030 | BOA | 100 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.12.2030 | DUB | 800 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | | | | | | € (308) | € (5) | € (303) | (1,09) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 1.212 | $ | 309 | DUB | € 4 | € (1) | € 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 321 | BRL | 1.212 | DUB | 8 | (21) | (13) | (0,05) |
| 01/2016 | | 492 | € | 453 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 453 | $ | 483 | HUS | 0 | (9) | (9) | (0,03) |
| 01/2016 | JPY | 36.300 | € | 278 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 306 | BRL | 1.212 | DUB | 1 | (4) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | BRL | 1.326 | $ | 361 | MSB | 27 | 0 | 27 | 0,10 |
| 02/2016 | € | 480 | DKK | 3.580 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 2.425 | € | 325 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.380 | | 722 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 146 | $ | 159 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 246 | NZD | 401 | FBF | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| 02/2016 | NZD | 833 | € | 520 | JPM | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 2.298 | | 2.135 | JPM | 23 | (2) | 21 | 0,08 |
| 02/2016 | € | 37 | $ | 39 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 92 | | 100 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 1.625 | € | 175 | UAG | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 27 | $ | 40 | BOA | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 16 | THB | 579 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 5.693 | $ | 330 | BRC | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 03/2016 | | 714 | | 42 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € 74 | € (45) | € 29 | 0,11 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ (278)** | **(0,98)** |
| **Summe Anlagen** | **€ 27.740** | **98,14** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 17 | € 24 | 0,09 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 3 | 2 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 42 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 19 | 18 | 0,06 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 5 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 495 | 495 | 1,75 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 18 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5 | 7 | 0,03 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 560** | **1,98** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ (34)** | **(0,12)** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 28.266** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 411 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 444 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(d) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 60 und Barmittel in Höhe von EUR 47 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(e) Barmittel in Höhe von EUR 44 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 28.050 | € 0 | € 28.050 |
| Finanzderivate[3] | (11) | (299) | 0 | (310) |
| **Summen** | **€ (11)** | **€ 27.751** | **€ 0** | **€ 27.740** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 26.340 | € 366 | € 26.706 |
| Finanzderivate[3] | (21) | (437) | 0 | (458) |
| **Summen** | **€ (21)** | **€ 25.903** | **€ 366** | **€ 26.248** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(g) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | (0,162 %) | 08.10.2015 | 12.01.2016 | € 417 | € (417) | (1,48) |

**(h) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € 2 | € 0 | € 2 |
| BRC | (311) | 444 | 133 |
| DUB | (10) | 0 | (10) |
| FBF | 6 | 0 | 6 |
| GLM | 1 | 0 | 1 |
| HUS | (8) | 0 | (8) |
| JPM | 17 | 0 | 17 |
| MSB | 27 | 0 | 27 |
| UAG | (2) | 0 | (2) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(i) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,23 | 99,22 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,04) | (0,08) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,07) | 0,10 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,98) | (1,72) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **France Government Bond** 2,250 % fällig am 25.07.2020 | € | 15.152 | € 17.630 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,750 % fällig am 15.04.2018 (a) | | 12.802 | 13.264 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 11.453 | 12.183 |
| **France Government Bond** 1,850 % fällig am 25.07.2027 | | 8.991 | 11.585 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 10.034 | 11.426 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 10.295 | 11.331 |
| **France Government Bond** 0,700 % fällig am 25.07.2030 | | 7.555 | 8.856 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 6.887 | 7.729 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 1,750 % fällig am 15.04.2020 (a) | | 6.899 | 7.650 |
| **France Government Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2021 | | 6.358 | 6.676 |
| **France Government Bond** 1,100 % fällig am 25.07.2022 | | 5.852 | 6.602 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 5.823 | 6.176 |
| **France Government Bond** 1,300 % fällig am 25.07.2019 | | 5.624 | 6.175 |
| **France Government Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2025 | | 5.781 | 6.139 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 3,100 % fällig am 15.09.2026 | | 4.791 | 5.905 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,100 % fällig am 15.04.2026 (a) | | 4.430 | 4.807 |
| **Republic of Germany Inflation Linked Bond** 0,500 % fällig am 15.04.2030 (a) | | 3.686 | 4.157 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 0,550 % fällig am 30.11.2019 (a) | | 3.885 | 4.005 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 3.327 | 3.388 |
| **France Government Bond** 1,800 % fällig am 25.07.2040 | | 2.299 | 3.334 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,150 % fällig am 12.11.2017 | | 3.040 | 3.177 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 1,800 % fällig am 30.11.2024 (a) | | 2.541 | 2.876 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 1,000 % fällig am 30.11.2030 (a) | | 2.670 | 2.611 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 1.918 | 2.562 |
| **Denmark Government Bond** 0,100 % fällig am 15.11.2023 | DKK | 16.648 | 2.381 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,250 % fällig am 22.04.2017 | € | 1.994 | 2.070 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **France Government Bond** 2,250 % fällig am 25.07.2020 | € | 12.729 | € 14.786 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,750 % fällig am 15.04.2018 (a) | | 12.884 | 13.361 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 11.303 | 12.099 |
| **France Government Bond** 0,700 % fällig am 25.07.2030 | | 10.091 | 11.860 |
| **France Government Bond** 1,850 % fällig am 25.07.2027 | | 9.094 | 11.613 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 9.782 | 10.746 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 8.685 | 9.933 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 9.243 | 9.487 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 1,750 % fällig am 15.04.2020 (a) | | 6.851 | 7.679 |
| **France Government Bond** 1,100 % fällig am 25.07.2022 | | 6.602 | 7.530 |
| **France Government Bond** 0,100 % fällig am 25.07.2021 | | 6.544 | 6.980 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 6.014 | 6.714 |
| **France Government Bond** 1,300 % fällig am 25.07.2019 | | 5.617 | 6.233 |
| **France Government Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2025 | | 4.804 | 5.063 |
| **Republic of Germany Inflation Linked Bond** 0,500 % fällig am 15.04.2030 (a) | | 4.283 | 4.935 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,150 % fällig am 12.11.2017 | | 4.331 | 4.529 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,100 % fällig am 15.04.2023 (a) | | 4.127 | 4.465 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 0,550 % fällig am 30.11.2019 (a) | | 4.095 | 4.165 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,100 % fällig am 15.04.2026 (a) | | 3.720 | 4.039 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 3,100 % fällig am 15.09.2026 | | 3.220 | 3.925 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 3.101 | 3.322 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 1,800 % fällig am 30.11.2024 (a) | | 2.337 | 2.627 |
| **France Government Bond** 1,800 % fällig am 25.07.2040 | | 1.691 | 2.401 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** 1,000 % fällig am 30.11.2030 (a) | | 2.380 | 2.276 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,250 % fällig am 22.04.2017 | | 2.010 | 2.074 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 1.493 | 1.913 |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Short-Term Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | | |
| **Abbey National Treasury Services PLC** | | | | | |
| 0,533 % fällig am 22.05.2019 | € | 5.100 | € | 5.095 | 0,60 |
| **Ayt Cedulas Cajas Global** | | | | | |
| 0,013 % fällig am 22.02.2018 | | 4.000 | | 3.966 | 0,47 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2016 | | 5.900 | | 5.936 | 0,70 |
| 4,000 % fällig am 20.12.2016 | | 3.500 | | 3.624 | 0,43 |
| **BA Covered Bond Issuer** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.04.2017 | | 16.050 | | 16.867 | 1,99 |
| **Banca Carige SpA** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.11.2016 | | 500 | | 514 | 0,06 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 | | 3.800 | | 553 | 0,06 |
| **Banco Popolare SC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 28.01.2016 | | 4.600 | | 4.609 | 0,54 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 0,709 % fällig am 28.03.2018 | | 1.300 | | 1.293 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 07.08.2017 | | 3.800 | | 4.061 | 0,48 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | $ | 2.000 | | 1.973 | 0,23 |
| **Bankia S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 05.10.2016 | € | 950 | | 975 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 05.07.2016 | | 2.500 | | 2.550 | 0,30 |
| 4,375 % fällig am 14.02.2017 | | 1.600 | | 1.666 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 29.06.2016 | | 5.500 | | 5.647 | 0,66 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 0,458 % fällig am 20.05.2019 | | 3.300 | | 3.318 | 0,39 |
| 5,431 % fällig am 07.09.2017 | | 2.800 | | 3.030 | 0,36 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 0,551 % fällig am 28.05.2018 | | 5.200 | | 5.238 | 0,62 |
| **BPE Financiaciones S.A.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.05.2016 | | 5.600 | | 5.648 | 0,66 |
| **Cajas Rurales Unidas SCC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.05.2016 | | 5.100 | | 5.156 | 0,61 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 0,477 % fällig am 11.11.2019 | | 7.200 | | 7.188 | 0,85 |
| 0,538 % fällig am 31.05.2017 | | 3.200 | | 3.197 | 0,38 |
| 0,747 % fällig am 09.06.2016 | $ | 650 | | 597 | 0,07 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | | |
| 0,141 % fällig am 13.01.2017 | € | 3.500 | | 3.501 | 0,41 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 3.100 | | 2.945 | 0,35 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,199 % fällig am 30.03.2017 | € | 1.200 | | 1.201 | 0,14 |
| 0,317 % fällig am 18.06.2018 | | 6.800 | | 6.801 | 0,80 |
| 0,500 % fällig am 29.03.2018 | | 2.600 | | 2.611 | 0,31 |
| **Depfa ACS Bank** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | | 21.200 | | 21.869 | 2,57 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | $ | 100 | | 93 | 0,01 |
| **Erste Europaische Pfandbrief- und Kommunalkreditbank AG in Luxemburg S.A.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 23.06.2016 | CHF | 3.300 | | 3.050 | 0,36 |
| 4,250 % fällig am 04.06.2018 | € | 2.500 | | 2.716 | 0,32 |
| 5,800 % fällig am 22.02.2017 | $ | 2.000 | | 1.922 | 0,23 |
| **German Postal Pensions Securitisation PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 18.01.2016 | € | 4.100 | | 4.109 | 0,48 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,258 % fällig am 23.05.2016 | | 1.600 | | 1.601 | 0,19 |
| 0,531 % fällig am 11.09.2018 | | 700 | | 700 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 09.05.2016 | | 5.100 | | 5.179 | 0,61 |
| **HBOS PLC** | | | | | |
| 0,567 % fällig am 21.03.2017 | | 3.500 | | 3.496 | 0,41 |
| 6,750 % fällig am 21.05.2018 | $ | 1.200 | | 1.208 | 0,14 |
| **Heta Asset Resolution AG** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 13.06.2016 | CHF | 6.800 | | 6.226 | 0,73 |
| **IM Cedulas 9 Fondo de Titulazion de Activos** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 09.06.2016 | € | 2.000 | | 2.035 | 0,24 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 0,998 % fällig am 17.04.2019 | | 5.500 | | 5.537 | 0,65 |
| 4,000 % fällig am 09.11.2017 | | 4.200 | | 4.481 | 0,53 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,489 % fällig am 27.01.2020 | | 900 | | 900 | 0,11 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.11.2021 | € | 1.600 | € | 1.646 | 0,19 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | | |
| 0,386 % fällig am 28.04.2017 | | 6.800 | | 6.788 | 0,80 |
| 2,500 % fällig am 19.09.2016 | | 200 | | 203 | 0,02 |
| **LeasePlan Finance NV** | | | | | |
| 0,107 % fällig am 08.09.2016 | | 3.500 | | 3.481 | 0,41 |
| **Leveraged Finance Europe Capital II BV** | | | | | |
| 0,740 % fällig am 02.03.2020 | | 457 | | 458 | 0,05 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 0,454 % fällig am 09.10.2018 | | 3.200 | | 3.213 | 0,38 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 0,432 % fällig am 02.11.2018 | | 7.400 | | 7.410 | 0,87 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 200 | | 192 | 0,02 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.07.2016 | DKK | 245.200 | | 33.051 | 3,89 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | | 15.300 | | 2.067 | 0,24 |
| **Realkredit Danmark** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 28.400 | | 3.826 | 0,45 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.11.2016 | € | 4.000 | | 4.041 | 0,48 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | | |
| 4,350 % fällig am 23.01.2017 | | 3.900 | | 4.045 | 0,48 |
| 6,934 % fällig am 09.04.2018 | | 1.100 | | 1.234 | 0,15 |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 100 | | 100 | 0,01 |
| **Santander Issuances SAU** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 23.03.2017 | € | 3.200 | | 3.193 | 0,38 |
| **Slovenska izvozna in razvojna banka dd** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | | 1.100 | | 1.116 | 0,13 |
| 3,232 % fällig am 29.03.2016 (f) | | 1.000 | | 1.010 | 0,12 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 0,126 % fällig am 05.09.2016 | | 1.700 | | 1.701 | 0,20 |
| 0,199 % fällig am 15.05.2017 | | 2.800 | | 2.803 | 0,33 |
| 0,500 % fällig am 15.05.2018 | | 1.300 | | 1.307 | 0,15 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | $ | 3.000 | | 2.889 | 0,34 |
| **Unibail-Rodamco SE** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 26.06.2017 | € | 2.150 | | 2.196 | 0,26 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 0,902 % fällig am 10.04.2017 | | 1.700 | | 1.711 | 0,20 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | | |
| 0,822 % fällig am 15.12.2017 | | 1.500 | | 1.506 | 0,18 |
| 2,125 % fällig am 25.07.2016 | | 5.700 | | 5.759 | 0,68 |
| **WM Covered Bond Program** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 27.09.2016 | | 15.700 | | 16.142 | 1,90 |
| | | | | 287.970 | 33,90 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **3M Co.** | | | | | |
| 0,159 % fällig am 09.11.2018 | | 1.400 | | 1.400 | 0,16 |
| **Actavis Funding SCS** | | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | $ | 4.005 | | 3.701 | 0,44 |
| **Akzo Nobel NV** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 06.04.2016 | £ | 2.700 | | 3.726 | 0,44 |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | | |
| 0,198 % fällig am 19.10.2018 | € | 2.300 | | 2.288 | 0,27 |
| **Aquarius + Investments PLC for Relx Finance BV** | | | | | |
| 0,408 % fällig am 20.05.2017 | | 400 | | 401 | 0,05 |
| **Archer-Daniels-Midland Co.** | | | | | |
| 0,369 % fällig am 24.06.2019 | | 3.800 | | 3.800 | 0,45 |
| **Banque PSA Finance S.A.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 04.04.2016 | $ | 1.500 | | 1.392 | 0,16 |
| **BMW US Capital LLC** | | | | | |
| 0,149 % fällig am 20.04.2018 | € | 9.300 | | 9.250 | 1,09 |
| **Brenntag Finance BV** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 19.07.2018 | | 2.600 | | 2.908 | 0,34 |
| **Cap Gemini S.A.** | | | | | |
| 0,718 % fällig am 02.07.2018 | | 4.000 | | 4.030 | 0,47 |
| **Carlsberg Breweries** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 13.10.2017 | | 2.000 | | 2.108 | 0,25 |
| **Caterpillar International Finance Ltd.** | | | | | |
| 0,141 % fällig am 13.05.2018 | | 900 | | 898 | 0,11 |
| 0,199 % fällig am 27.09.2017 | | 1.100 | | 1.100 | 0,13 |
| **CMA CGM S.A.** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.12.2018 | | 1.500 | | 1.471 | 0,17 |
| **Coca-Cola Co.** | | | | | |
| 0,117 % fällig am 09.09.2019 | € | 1.600 | € | 1.593 | 0,19 |
| **Conti-Gummi Finance BV** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.03.2017 | | 4.200 | | 4.312 | 0,51 |
| **Daimler AG** | | | | | |
| 0,254 % fällig am 07.10.2016 | | 200 | | 200 | 0,02 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 20.01.2017 | | 5.500 | | 5.836 | 0,69 |
| **DH Europe Finance S.A.** | | | | | |
| 0,319 % fällig am 30.06.2017 | | 1.600 | | 1.605 | 0,19 |
| **Experian Finance PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.06.2017 | $ | 200 | | 183 | 0,02 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,397 % fällig am 10.02.2018 | € | 900 | | 892 | 0,10 |
| 1,625 % fällig am 09.09.2016 | | 2.200 | | 2.218 | 0,26 |
| 1,750 % fällig am 21.05.2018 | | 900 | | 924 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 12.05.2016 | | 2.050 | | 2.061 | 0,24 |
| **Fiat Chrysler Finance Europe** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.04.2016 | | 1.300 | | 1.318 | 0,16 |
| 7,000 % fällig am 23.03.2017 | | 2.000 | | 2.122 | 0,25 |
| 7,750 % fällig am 17.10.2016 | | 200 | | 210 | 0,02 |
| **Fiat Finance North America, Inc.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 12.06.2017 | | 600 | | 631 | 0,07 |
| **Glencore Finance Europe S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 06.04.2016 | CHF | 2.000 | | 1.830 | 0,22 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2017 (a) | € | 3.200 | | 3.150 | 0,37 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.10.2016 | | 700 | | 721 | 0,08 |
| **HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A.** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.01.2017 | | 3.600 | | 3.878 | 0,46 |
| **Hella KGaA Hueck & Co.** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2017 | | 3.400 | | 3.442 | 0,41 |
| **HOCHTIEF AG** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.03.2017 | | 6.000 | | 6.318 | 0,74 |
| **Hutchison Whampoa Finance 09 Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.11.2016 | | 8.500 | | 8.835 | 1,04 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2016 | £ | 2.200 | | 3.095 | 0,36 |
| 8,375 % fällig am 17.02.2016 | € | 2.000 | | 2.019 | 0,24 |
| **Indesit Co. SpA** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.04.2018 | | 4.500 | | 4.848 | 0,57 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2016 | £ | 1.530 | | 2.166 | 0,25 |
| **ITV PLC** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 05.01.2017 | | 300 | | 426 | 0,05 |
| **Mercedes-Benz Australia** | | | | | |
| 0,075 % fällig am 14.03.2016 | € | 2.300 | | 2.299 | 0,27 |
| **METRO AG** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.05.2016 | CHF | 6.000 | | 5.554 | 0,65 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.04.2017 | € | 5.400 | | 5.756 | 0,68 |
| **Pernod-Ricard S.A.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 18.03.2016 | | 1.350 | | 1.363 | 0,16 |
| **Pirelli & C. SpA** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.02.2016 | | 4.400 | | 4.425 | 0,52 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | | |
| 0,466 % fällig am 27.11.2017 | | 1.000 | | 998 | 0,12 |
| 0,531 % fällig am 16.07.2018 | | 8.300 | | 8.260 | 0,97 |
| **Reed Elsevier Investments PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 20.10.2016 | £ | 1.100 | | 1.544 | 0,18 |
| 7,000 % fällig am 11.12.2017 | | 500 | | 746 | 0,09 |
| **Rentokil Initial PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.03.2016 | | 1.252 | | 1.717 | 0,20 |
| **Roche Holdings, Inc.** | | | | | |
| 0,943 % fällig am 30.09.2019 | $ | 5.600 | | 5.105 | 0,60 |
| **SAP SE** | | | | | |
| 0,208 % fällig am 20.11.2018 | € | 1.600 | | 1.605 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 10.04.2017 | | 700 | | 730 | 0,09 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2018 | | 800 | | 818 | 0,10 |
| **Sky Group Finance PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 20.10.2017 | £ | 1.800 | | 2.613 | 0,31 |
| **Sky PLC** | | | | | |
| 0,618 % fällig am 01.04.2020 | € | 1.600 | | 1.598 | 0,19 |
| **Solvay S.A.** | | | | | |
| 0,706 % fällig am 01.12.2017 | | 4.100 | | 4.117 | 0,48 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Statoil ASA** | | | | |
| 0,117 % fällig am 19.08.2019 | € | 1.500 | € 1.496 | 0,18 |
| **Symrise AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 25.10.2017 | | 5.300 | 5.605 | 0,66 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 0,702 % fällig am 10.04.2017 | | 400 | 401 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 02.02.2018 | £ | 1.300 | 1.878 | 0,22 |
| 5,811 % fällig am 05.09.2017 | € | 3.800 | 4.144 | 0,49 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 12.09.2016 | | 5.400 | 5.593 | 0,66 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 10.12.2016 | | 2.160 | 2.265 | 0,27 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,319 % fällig am 14.08.2017 | | 500 | 490 | 0,06 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,201 % fällig am 16.10.2017 | | 2.300 | 2.247 | 0,26 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,197 % fällig am 11.08.2017 | | 4.300 | 4.212 | 0,50 |
| **Volvo Treasury AB** | | | | |
| 0,236 % fällig am 05.09.2016 | | 5.100 | 5.099 | 0,60 |
| 0,331 % fällig am 11.09.2017 | | 2.400 | 2.396 | 0,28 |
| 5,000 % fällig am 31.05.2017 | | 200 | 213 | 0,02 |
| **Wendel S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 26.05.2016 | | 4.000 | 4.070 | 0,48 |
| 6,750 % fällig am 20.04.2018 | | 2.300 | 2.619 | 0,31 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 26.04.2019 | | 1.400 | 1.405 | 0,17 |
| | | | 196.687 | 23,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,462 % fällig am 04.06.2019 | | 5.000 | 5.006 | 0,59 |
| 5,875 % fällig am 28.04.2017 | £ | 300 | 430 | 0,05 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 3,830 % fällig am 06.10.2017 | € | 200 | 212 | 0,02 |
| **Eileme 2 AB** | | | | |
| 11,750 % fällig am 31.01.2020 | | 2.000 | 2.140 | 0,25 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.03.2016 | £ | 115 | 158 | 0,02 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.05.2016 | | 500 | 688 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 22.05.2018 | € | 500 | 564 | 0,07 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2018 | £ | 1.800 | 2.640 | 0,31 |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | € | 2.800 | 2.974 | 0,35 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2017 | £ | 400 | 591 | 0,07 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,042 % fällig am 15.09.2016 | $ | 600 | 556 | 0,07 |
| | | | 15.959 | 1,88 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 500.616 | 58,94 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | | 7.553 | 804 | 0,09 |
| **Casa D'este Finance SRL** | | | | |
| 0,222 % fällig am 15.09.2040 | € | 254 | 247 | 0,03 |
| **Claris Finance Srl** | | | | |
| 0,159 % fällig am 20.06.2055 | | 81 | 80 | 0,01 |
| **DECO 8-UK Conduit 2 PLC** | | | | |
| 0,759 % fällig am 27.04.2018 | £ | 1.415 | 1.902 | 0,22 |
| **Dutch MBS XVI BV** | | | | |
| 1,449 % fällig am 25.05.2043 | € | 881 | 886 | 0,10 |
| **Fosse Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,979 % fällig am 18.10.2054 | £ | 1.300 | 1.760 | 0,21 |
| 1,348 % fällig am 18.10.2054 | € | 720 | 723 | 0,08 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 0,896 % fällig am 27.11.2024 | | 3.400 | 3.425 | 0,40 |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | | 648 | 654 | 0,08 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | |
| 0,088 % fällig am 20.11.2022 | | 775 | 760 | 0,09 |
| **Lunet RMBS BV** | | | | |
| 0,369 % fällig am 26.12.2045 | | 258 | 258 | 0,03 |
| **Permanent Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 15.07.2042 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Storm BV** | | | | |
| 1,497 % fällig am 22.01.2054 | € | 6.000 | € 6.083 | 0,72 |
| **Taurus GMF1 PLC** | | | | |
| 0,958 % fällig am 21.05.2024 | | 384 | 388 | 0,05 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,101 % fällig am 10.10.2040 | | 146 | 145 | 0,02 |
| | | | 18.215 | 2,14 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets 5 SPV Srl** | | | | |
| 1,449 % fällig am 20.04.2040 | | 130 | 130 | 0,02 |
| **Alpstar CLO 2 PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.05.2024 | | 7.200 | 6.957 | 0,82 |
| **Ares European CLO III BV** | | | | |
| 0,256 % fällig am 15.08.2024 | | 861 | 857 | 0,10 |
| **Avoca Clo II BV** | | | | |
| 1,149 % fällig am 15.01.2020 | | 71 | 71 | 0,01 |
| **Avoca CLO V PLC** | | | | |
| 0,428 % fällig am 03.08.2022 | | 494 | 493 | 0,06 |
| **Ayt FTPYME II FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.10.2032 | | 50 | 50 | 0,01 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,189 % fällig am 20.12.2022 | | 600 | 600 | 0,07 |
| **Bilkreditt 5 Ltd.** | | | | |
| 0,229 % fällig am 25.03.2028 | | 961 | 961 | 0,11 |
| **Cadogan Square CLO II BV** | | | | |
| 0,278 % fällig am 12.08.2022 | | 984 | 983 | 0,12 |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | | 248 | 246 | 0,03 |
| **Celf Loan Partners BV** | | | | |
| 0,429 % fällig am 18.07.2021 | | 644 | 644 | 0,08 |
| **Celf Loan Partners II PLC** | | | | |
| 0,342 % fällig am 15.12.2021 | | 89 | 88 | 0,01 |
| **Compartment VCL 20** | | | | |
| 0,072 % fällig am 21.06.2020 | | 141 | 141 | 0,02 |
| **Compartment VCL 21** | | | | |
| 0,002 % fällig am 21.02.2021 | | 295 | 294 | 0,03 |
| **Compartment VCL 22** | | | | |
| 0,422 % fällig am 21.08.2021 | | 2.311 | 2.310 | 0,27 |
| **Dalradian European Clo IV BV** | | | | |
| 0,547 % fällig am 08.08.2023 | | 287 | 286 | 0,03 |
| **eleX Alpha S.A.** | | | | |
| 0,436 % fällig am 21.03.2023 | | 200 | 197 | 0,02 |
| **Etruria Securitisation SPV Srl** | | | | |
| 0,447 % fällig am 26.01.2055 | | 238 | 237 | 0,03 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | | 520 | 518 | 0,06 |
| **Euro-Galaxy II CLO BV** | | | | |
| 0,238 % fällig am 29.10.2022 | | 1.927 | 1.901 | 0,22 |
| **Gamma-Sociedade Titularizacao de Creditos S.A.** | | | | |
| 1,149 % fällig am 28.01.2044 | | 3.986 | 3.981 | 0,47 |
| **GUERRIERO SPV 1 Srl** | | | | |
| 0,447 % fällig am 26.10.2060 | | 47 | 47 | 0,01 |
| **Harbourmaster CLO 8 BV** | | | | |
| 0,195 % fällig am 14.12.2022 | | 141 | 140 | 0,02 |
| **Harvest CLO III-A S.A.** | | | | |
| 0,350 % fällig am 08.06.2021 | | 673 | 666 | 0,08 |
| **Harvest CLO IV S.A.** | | | | |
| 0,299 % fällig am 29.07.2021 | | 1.862 | 1.850 | 0,22 |
| **Harvest CLO V S.A.** | | | | |
| 0,205 % fällig am 05.04.2024 | | 173 | 171 | 0,02 |
| **Highlander Euro CDO III BV** | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | | 2.557 | 2.501 | 0,29 |
| **Highway BV** | | | | |
| 0,229 % fällig am 26.05.2025 | | 4.000 | 4.001 | 0,47 |
| **IM Grupo Banco Popular FTPYME I FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2039 | | 879 | 871 | 0,10 |
| **Jubilee CDO V BV** | | | | |
| 0,282 % fällig am 21.08.2021 | | 178 | 177 | 0,02 |
| **Malin CLO BV** | | | | |
| 0,124 % fällig am 07.05.2023 | | 71 | 70 | 0,01 |
| 0,199 % fällig am 07.05.2023 | | 557 | 553 | 0,06 |
| **Master Credit Cards Pass Compartment France** | | | | |
| 0,199 % fällig am 25.10.2027 | | 1.200 | 1.199 | 0,14 |
| **MONVISO SRL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 23.06.2027 | € | 517 | € 518 | 0,06 |
| **Penta CLO 1 S.A.** | | | | |
| 0,172 % fällig am 04.06.2024 | | 1.723 | 1.707 | 0,20 |
| **Quarzo Cqs Srl** | | | | |
| 0,519 % fällig am 15.11.2030 | | 2.180 | 2.172 | 0,26 |
| **Red & Black Auto Germany 2** | | | | |
| 0,281 % fällig am 15.09.2022 | | 621 | 621 | 0,07 |
| **SCFI Rahoituspalvelut Ltd.** | | | | |
| 0,472 % fällig am 25.09.2023 | | 933 | 935 | 0,11 |
| **SIENA PMI Srl** | | | | |
| 0,751 % fällig am 05.11.2055 | | 2.701 | 2.697 | 0,32 |
| **Stichting Halcyon Structured Asset Management European CLO** | | | | |
| 0,369 % fällig am 24.07.2023 | | 500 | 495 | 0,06 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,396 % fällig am 27.08.2031 | | 1.173 | 1.172 | 0,14 |
| 0,616 % fällig am 27.11.2031 | | 2.244 | 2.246 | 0,26 |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | | 1.725 | 1.715 | 0,20 |
| 0,649 % fällig am 27.12.2032 | | 500 | 501 | 0,06 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 214 | 214 | 0,02 |
| **TITRISOCRAM** | | | | |
| 0,229 % fällig am 25.11.2035 | | 800 | 801 | 0,09 |
| | | | 49.985 | 5,88 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.03.2016 | CHF | 2.900 | 2.678 | 0,32 |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 (a) | | 4.900 | 4.963 | 0,58 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 700 | 741 | 0,09 |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.06.2019 (a) | | 500 | 539 | 0,06 |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 83.000 | 3.101 | 0,37 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (1,120 %) fällig am 19.02.2016 | | 45.000 | 1.666 | 0,20 |
| (0,490 %) fällig am 12.02.2016 | | 75.000 | 2.776 | 0,33 |
| (0,300 %) fällig am 22.04.2016 | | 56.000 | 2.073 | 0,24 |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | | 56.000 | 2.075 | 0,24 |
| (0,118 %) fällig am 02.09.2016 | | 223.000 | 8.261 | 0,97 |
| **Dutch Treasury Certificate** | | | | |
| (0,330 %) fällig am 29.01.2016 | € | 1.290 | 1.290 | 0,15 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,250 % fällig am 18.10.2017 | | 13.700 | 13.811 | 1,63 |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.02.2017 | | 2.200 | 2.315 | 0,27 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2018 | | 30.500 | 30.677 | 3,61 |
| **International Bank for Reconstruction & Development** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.11.2016 | ITL | 2.000.000 | 1.033 | 0,12 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| (0,089 %) fällig am 29.04.2016 | € | 2.500 | 2.500 | 0,29 |
| (0,009 %) fällig am 14.12.2016 | | 20.860 | 20.875 | 2,46 |
| 0,007 % fällig am 14.10.2016 | | 80 | 80 | 0,01 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2018 | | 21.600 | 21.926 | 2,58 |
| 2,550 % fällig am 22.10.2016 (b) | | 12.457 | 12.717 | 1,50 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2017 | | 2.000 | 2.128 | 0,25 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | | |
| 1,804 % fällig am 01.11.2018 | | 21.800 | 22.825 | 2,69 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,030 %) fällig am 14.03.2016 | JPY | 3.330.000 | 25.484 | 3,00 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 23.03.2017 | € | 2.396 | 2.505 | 0,30 |
| **Slovenia Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 06.04.2017 | | 1.800 | 1.797 | 0,21 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| (0,007 %) fällig am 13.05.2016 | | 650 | 650 | 0,08 |
| 0,007 % fällig am 14.10.2016 | | 200 | 200 | 0,02 |
| 0,014 % fällig am 09.12.2016 | | 17.070 | 17.081 | 2,01 |
| | | | 208.767 | 24,58 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (c)** | | 221.200 | 22.498 | 2,65 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Corelux S.A.** | | | |
| 0,020 % fällig am 08.02.2016 | € 6.000 | € 5.999 | 0,71 |
| **Imperial Tobacco PLC** | | | |
| 0,270 % fällig am 10.11.2016 | 1.000 | 999 | 0,12 |
| **Vodafone Group PLC** | | | |
| 0,195 % fällig am 30.09.2016 | 3.700 | 3.699 | 0,43 |
| 0,221 % fällig am 05.04.2016 | 3.300 | 3.299 | 0,39 |
| | | 13.996 | 1,65 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | |
| (0,320 %) fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert vom Land Hessen 0,875 % fällig am 10.12.2024 bewertet mit €13.711. Die Rückkauferlöse betragen €14.000.) | € 14.000 | € 14.000 | 1,65 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 828.077** | **97,49** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor Interest Rate March Futures | Long | 03/2017 | 162 | € (4) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ (4)** | **0,00** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | DKK | 53.696 | € | 7.218 | BOA | € 23 | € 0 | € 23 | 0,00 |
| 01/2016 | | 39.620 | | 5.324 | BPS | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 5.277 | DKK | 39.340 | DUB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.864 | | 43.766 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.370 | | 10.210 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 1.330.000 | € | 10.021 | CBK | 0 | (156) | (156) | (0,02) |
| 01/2016 | € | 1.878 | $ | 2.058 | CBK | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.798 | | 4.135 | DUB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 950.000 | € | 7.153 | GLM | 0 | (117) | (117) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2.000.000 | | 15.009 | HUS | 0 | (296) | (296) | (0,03) |
| 01/2016 | € | 1.046 | $ | 1.137 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.282 | JPY | 950.000 | MSB | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 737 | $ | 800 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.113 | | 10.788 | UAG | 0 | (182) | (182) | (0,02) |
| 01/2016 | JPY | 17.700 | € | 136 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 18.014 | | 16.490 | UAG | 0 | (93) | (93) | (0,01) |
| 02/2016 | CHF | 11.077 | | 10.267 | JPM | 73 | 0 | 73 | 0,01 |
| 02/2016 | | 1.907 | | 1.758 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 45.229 | | 1.688 | UAG | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | | 75.158 | | 2.794 | UAG | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 1.913 | | 2.633 | BOA | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| 02/2016 | | 699 | | 967 | CBK | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 6.255 | £ | 4.440 | FBF | 0 | (236) | (236) | (0,03) |
| 02/2016 | £ | 985 | € | 1.367 | FBF | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 8.055 | | 865 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.972 | £ | 3.497 | JPM | 0 | (231) | (231) | (0,03) |
| 02/2016 | £ | 23.577 | € | 33.180 | JPM | 1.217 | 0 | 1.217 | 0,14 |
| 02/2016 | $ | 29.515 | | 27.326 | NAB | 181 | 0 | 181 | 0,02 |
| 02/2016 | € | 14.280 | $ | 15.327 | UAG | 0 | (184) | (184) | (0,02) |
| 02/2016 | | 16.005 | | 17.495 | UAG | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| 04/2016 | CHF | 2.070 | € | 1.908 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | CZK | 56.106 | | 2.091 | CBK | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 04/2016 | DKK | 43.766 | | 5.867 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 05/2016 | CHF | 6.113 | | 5.865 | JPM | 231 | 0 | 231 | 0,03 |
| 07/2016 | DKK | 109.216 | | 14.693 | BOA | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| 07/2016 | | 138.785 | | 18.662 | MSB | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| 09/2016 | CZK | 56.084 | | 2.078 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 09/2016 | | 80.120 | | 2.984 | SOG | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 09/2016 | | 143.145 | | 5.325 | UAG | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 10/2016 | | 38.358 | | 1.441 | DUB | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 10/2016 | | 45.469 | | 1.706 | JPM | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | | | | | | € 2.125 | € (1.537) | € 588 | 0,07 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 588** | **0,07** |
| **Summe Anlagen** | **€ 828.661** | **97,56** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 63 | € 42 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 67 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 32 | 32 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 555 | 61 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 30 | 30 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 9 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 37 | 25 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 10 | 7 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 30.732 | 30.732 | 3,62 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 28 | 0 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 30.942** | **3,64** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ (10.187)** | **(1,20)** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 849.416** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 6.727 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(c) **Der Euro Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von EUR 590 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(e) **Barmittel in Höhe von EUR 109 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(f) **Beschränkt übertragbare Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Slovenska izvozna in razvojna banka dd | 3,232 % | 29.03.2016 | 26.03.2014 | € 1.005 | € 1.010 | 0,12 |

(g) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 22.498 | € 805.579 | € 0 | € 828.077 |
| Finanzderivate[3] | (4) | 588 | 0 | 584 |
| **Summen** | **€ 22.494** | **€ 806.167** | **€ 0** | **€ 828.661** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 576.632 | € 240 | € 576.872 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 745 | 0 | 745 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (1.067) | 0 | (1.067) |
| **Summen** | **€ 0** | **€ 576.310** | **€ 240** | **€ 576.550** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,250 %) | 31.12.2015 | 30.12.2017 | € 3.071 | € (3.071) | (0,36) |
| CFR | (1,000 %) | 11.12.2015 | 10.12.2017 | 3.146 | (3.145) | (0,37) |
| CFR | (0,400 %) | 24.11.2015 | 24.11.2017 | 549 | (548) | (0,07) |
| | | | | | € (6.764) | (0,80) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € 107 | € 0 | € 107 |
| BPS | 15 | 0 | 15 |
| CBK | (107) | 0 | (107) |
| DUB | 16 | (270) | (254) |
| FBF | (204) | 0 | (204) |
| GLM | (117) | 0 | (117) |
| HUS | (294) | 0 | (294) |
| JPM | 1.283 | (1.100) | 183 |
| MSB | 34 | 0 | 34 |
| NAB | 181 | (460) | (279) |
| SCX | 3 | 0 | 3 |
| SOG | 8 | 0 | 8 |
| UAG | (337) | 590 | 253 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 97,49 | 100,27 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,07 | (0,18) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,13 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Short-Term Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 43.200 | € 44.134 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,040)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 5.400.000 | 40.100 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.07.2016 | DKK | 245.200 | 33.241 |
| **France Government Bond** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2018 | € | 30.500 | 30.685 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,030)% fällig am 14.03.2016 | JPY | 3.330.000 | 25.054 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 1,804 % fällig am 01.11.2018 | € | 21.800 | 22.947 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 221.200 | 22.483 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.01.2018 | € | 21.600 | 21.853 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| (0,009)% fällig am 14.12.2016 | | 20.860 | 20.862 |
| **BA Covered Bond Issuer** | | | |
| 4,250 % fällig am 05.04.2017 | | 19.050 | 20.400 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 31.10.2017 | | 19.000 | 19.055 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,014 % fällig am 09.12.2016 | | 17.070 | 17.068 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 1,078 % fällig am 15.04.2018 | | 16.100 | 16.491 |
| **Europäische Union** | | | |
| 3,625 % fällig am 06.04.2016 | | 15.971 | 16.247 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | | 15.000 | 14.996 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2015 | | 14.300 | 14.557 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 23.09.2015 | | 14.400 | 14.406 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | |
| 2,750 % fällig am 18.07.2016 | | 14.000 | 14.404 |
| **Depfa ACS Bank** | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | | 13.500 | 14.178 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | |
| 0,250 % fällig am 18.10.2017 | | 13.700 | 13.842 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2015 | € | 43.200 | € 44.086 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,040)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 5.400.000 | 39.528 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| (0,079)% fällig am 28.01.2015 | € | 30.000 | 30.001 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 23.700 | 25.412 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 31.10.2017 | | 21.600 | 21.734 |
| **Land Hessen** | | | |
| 3,500 % fällig am 04.01.2016 | | 17.000 | 17.572 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 1,078 % fällig am 15.04.2018 | | 16.100 | 16.403 |
| **Europäische Union** | | | |
| 3,625 % fällig am 06.04.2016 | | 15.971 | 16.230 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | | 15.000 | 14.995 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,202 % fällig am 14.04.2015 | | 14.800 | 14.796 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2015 | | 14.300 | 14.554 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 23.09.2015 | | 14.400 | 14.406 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | |
| 2,750 % fällig am 18.07.2016 | | 14.000 | 14.396 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 1,000 % fällig am 11.07.2016 | | 13.700 | 13.867 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 1,150 % fällig am 15.05.2017 | | 13.100 | 13.370 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2016 | | 12.150 | 12.673 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | |
| 1,125 % fällig am 30.11.2017 | | 12.000 | 12.388 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.12.2015 | | 12.000 | 11.983 |
| **KFW** | | | |
| 0,250 % fällig am 02.05.2016 | | 10.000 | 10.040 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,041 % fällig am 19.02.2016 | | 10.000 | 9.995 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,101 % fällig am 14.09.2015 | | 10.000 | 9.987 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 8.990 | 9.290 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2017 | | 8.500 | 9.182 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 67.100 | 9.016 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.10.2015 | € | 8.500 | 8.504 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2015 | | 8.400 | 8.452 |
| **German Postal Pensions Securitisation PLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 18.01.2016 | | 7.900 | 8.113 |
| **Coral Capital** | | | |
| 0,000 % fällig am 17.07.2015 | | 8.000 | 8.000 |

(a) Der Euro Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Ultra-Long Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | | |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | $ | 300 | € | 240 | 0,45 |
| **Banco Popolare SC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | € | 200 | | 201 | 0,38 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 400 | | 411 | 0,78 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | $ | 200 | | 187 | 0,35 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 4,055 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 6.000 | | 343 | 0,65 |
| **Bankia S.A.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.01.2019 | € | 400 | | 422 | 0,80 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 300 | | 315 | 0,60 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 200 | | 272 | 0,51 |
| **CNP Assurances** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.06.2047 | € | 100 | | 97 | 0,18 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 400 | | 437 | 0,83 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | $ | 500 | | 496 | 0,94 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 300 | | 309 | 0,58 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 0,200 % fällig am 31.07.2018 | | 800 | | 802 | 1,52 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | $ | 900 | | 830 | 1,57 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,591 % fällig am 29.05.2020 | € | 400 | | 398 | 0,75 |
| **Granite Mortgages 03-2 PLC** | | | | | |
| 1,062 % fällig am 20.07.2043 | £ | 48 | | 65 | 0,12 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | | 198 | 0,37 |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | | 200 | | 192 | 0,36 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.11.2017 | | 600 | | 640 | 1,21 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,489 % fällig am 27.01.2020 | | 100 | | 100 | 0,19 |
| **KBC Groep NV** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.03.2049 | | 100 | | 100 | 0,19 |
| **KFW** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2021 | SEK | 1.000 | | 123 | 0,23 |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | € | 300 | | 305 | 0,58 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 150 | | 131 | 0,25 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 100 | | 89 | 0,17 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 900 | | 120 | 0,23 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 6.760 | | 868 | 1,64 |
| **Realkredit Danmark** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2023 | | 2.100 | | 294 | 0,56 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 800 | | 107 | 0,20 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 2.469 | | 316 | 0,60 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | | 192 | 0,36 |
| **Slovenska izvozna in razvojna banka dd** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | € | 400 | | 406 | 0,77 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | | 195 | 0,37 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | £ | 90 | | 127 | 0,24 |
| | | | | 10.328 | 19,53 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | $ | 200 | | 185 | 0,35 |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 | | 600 | | 555 | 1,05 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | € | 250 | | 262 | 0,49 |
| **American Honda Finance Corp.** | | | | | |
| 0,281 % fällig am 11.03.2019 | € | 100 | € | 100 | 0,19 |
| **California Resources Corp.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | $ | 69 | | 19 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 184 | | 89 | 0,17 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 100 | | 26 | 0,05 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | | |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 550 | | 509 | 0,96 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | | 100 | | 101 | 0,19 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 600 | | 610 | 1,15 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | | | |
| 4,650 % fällig am 20.05.2035 | $ | 200 | | 171 | 0,32 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 200 | | 195 | 0,37 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.01.2023 | | 90 | | 95 | 0,18 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 200 | | 175 | 0,33 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 26.10.2016 | | 500 | | 501 | 0,95 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | | 200 | | 200 | 0,38 |
| | | | | 3.793 | 7,17 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 05.09.2023 | | 400 | | 387 | 0,73 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.01.2049 | $ | 100 | | 87 | 0,16 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.01.2017 | € | 700 | | 733 | 1,39 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | $ | 200 | | 184 | 0,35 |
| **Orange S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | € | 300 | | 300 | 0,57 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | $ | 200 | | 171 | 0,32 |
| **Shell International Finance BV** | | | | | |
| 0,272 % fällig am 15.09.2019 | € | 100 | | 100 | 0,19 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2017 | £ | 200 | | 295 | 0,56 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 2,042 % fällig am 15.09.2016 | $ | 230 | | 213 | 0,40 |
| | | | | 2.470 | 4,67 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | | 16.591 | 31,37 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 402 | | 353 | 0,67 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 306 | | 288 | 0,54 |
| | | | | 641 | 1,21 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | | |
| **Apulia Mortgages Finance N 3 SRL** | | | | | |
| 0,659 % fällig am 20.06.2058 | € | 148 | | 147 | 0,28 |
| **Argo Mortgage 2 Srl** | | | | | |
| 0,119 % fällig am 27.10.2043 | | 156 | | 156 | 0,29 |
| **Auburn Securities 9 PLC** | | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | £ | 193 | | 260 | 0,49 |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 2.317 | | 247 | 0,47 |
| **Claris ABS Srl** | | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | € | 372 | | 366 | 0,69 |
| **Creso Srl** | | | | | |
| 0,569 % fällig am 30.12.2060 | | 446 | | 443 | 0,84 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | £ | 366 | | 480 | 0,91 |
| **DECO 8-UK Conduit 2 PLC** | | | | | |
| 0,759 % fällig am 27.04.2018 | | 123 | | 165 | 0,31 |
| **Deco Ltd.** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.11.2024 | € | 96 | | 96 | 0,18 |
| **Dutch MBS XVIII BV** | | | | | |
| 0,382 % fällig am 02.02.2045 | € | 12 | € | 13 | 0,02 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,733 % fällig am 15.06.2044 | £ | 377 | | 477 | 0,90 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.12.2044 | | 271 | | 353 | 0,67 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | | |
| 1,496 % fällig am 27.08.2024 | € | 278 | | 281 | 0,53 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 52 | | 49 | 0,09 |
| **Grecale RMBS Srl** | | | | | |
| 0,447 % fällig am 27.01.2061 | | 79 | | 78 | 0,15 |
| **Heliconus Srl** | | | | | |
| 0,257 % fällig am 10.02.2036 | | 89 | | 88 | 0,17 |
| **Infinity Classico** | | | | | |
| 0,109 % fällig am 15.02.2024 | | 242 | | 238 | 0,45 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | | |
| 0,088 % fällig am 20.11.2022 | | 67 | | 66 | 0,13 |
| **Landmark Mortgage Securities No. 2 PLC** | | | | | |
| 0,785 % fällig am 17.06.2039 | £ | 211 | | 258 | 0,49 |
| **Leek Finance Number Seventeen PLC** | | | | | |
| 0,147 % fällig am 21.12.2037 | € | 298 | | 316 | 0,60 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,741 % fällig am 01.01.2061 | £ | 86 | | 106 | 0,20 |
| 0,763 % fällig am 01.12.2060 | | 131 | | 162 | 0,31 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | € | 157 | | 159 | 0,30 |
| **MINT PLC** | | | | | |
| 1,200 % fällig am 22.02.2025 | | 200 | | 200 | 0,38 |
| 1,872 % fällig am 22.02.2025 | £ | 300 | | 407 | 0,77 |
| **Mortgages No.7 PLC** | | | | | |
| 1,040 % fällig am 31.10.2038 | | 149 | | 192 | 0,36 |
| **Nemus II Arden PLC** | | | | | |
| 0,803 % fällig am 15.02.2020 | | 533 | | 703 | 1,33 |
| **Newgate Funding** | | | | | |
| 0,713 % fällig am 15.12.2050 | | 49 | | 65 | 0,12 |
| **Storm BV** | | | | | |
| 1,497 % fällig am 22.01.2054 | € | 100 | | 101 | 0,19 |
| **Taurus CMBS UK Ltd.** | | | | | |
| 1,979 % fällig am 01.05.2022 | £ | 161 | | 217 | 0,41 |
| **Taurus GMF1 PLC** | | | | | |
| 1,408 % fällig am 21.05.2024 | € | 384 | | 388 | 0,73 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | | |
| 0,101 % fällig am 10.10.2040 | | 340 | | 337 | 0,64 |
| | | | | 7.614 | 14,40 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Cadogan Square CLO BV** | | | | | |
| 0,308 % fällig am 01.02.2022 | | 105 | | 105 | 0,20 |
| **Cadogan Square CLO IV BV** | | | | | |
| 0,279 % fällig am 24.07.2023 | | 134 | | 133 | 0,25 |
| **Compartment VCL 22** | | | | | |
| 0,422 % fällig am 21.08.2021 | | 193 | | 193 | 0,36 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 1,350 % fällig am 27.11.2028 | | 400 | | 400 | 0,76 |
| **Driver Australia One Trust** | | | | | |
| 2,915 % fällig am 21.12.2021 | AUD | 210 | | 140 | 0,27 |
| **Duchess VII CLO BV** | | | | | |
| 0,111 % fällig am 28.02.2023 | € | 22 | | 22 | 0,04 |
| **Etruria Securitisation SPV Srl** | | | | | |
| 0,447 % fällig am 26.01.2055 | | 40 | | 39 | 0,08 |
| **Green Park CDO BV** | | | | | |
| 0,266 % fällig am 18.03.2023 | | 87 | | 87 | 0,16 |
| **Harbourmaster CLO 7 BV** | | | | | |
| 0,199 % fällig am 22.09.2022 | | 80 | | 80 | 0,15 |
| **LightPoint Pan-European CLO PLC** | | | | | |
| 0,182 % fällig am 31.01.2022 | | 9 | | 9 | 0,02 |
| **Panther CDO IV BV** | | | | | |
| 0,304 % fällig am 20.03.2084 | | 888 | | 858 | 1,62 |
| **Red & Black Auto Germany 2** | | | | | |
| 0,281 % fällig am 15.09.2022 | | 59 | | 59 | 0,11 |
| **SCF Rahoituspalvelut I Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,220 % fällig am 25.11.2024 | | 280 | | 280 | 0,53 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 0,132 % fällig am 15.12.2023 | | 650 | | 629 | 1,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,142 % fällig am 17.06.2024 | € | 102 | € 97 | 0,18 |
| 0,422 % fällig am 15.12.2033 | | 565 | 488 | 0,92 |
| **TITRISOCRAM** | | | | |
| 0,229 % fällig am 25.11.2035 | | 100 | 100 | 0,19 |
| | | | 3.719 | 7,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 0,067 % fällig am 19.09.2018 | | 200 | 201 | 0,38 |
| 1,250 % fällig am 27.02.2018 | | 800 | 824 | 1,56 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.03.2016 | CHF | 400 | 369 | 0,70 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 400 | 432 | 0,82 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 4,125 % fällig am 21.05.2024 | | 100 | 118 | 0,22 |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.11.2025 | | 200 | 208 | 0,39 |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 11.000 | 411 | 0,78 |
| 6,950 % fällig am 26.01.2016 | | 5.000 | 186 | 0,35 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (1,120 %) fällig am 19.02.2016 | | 3.000 | 111 | 0,21 |
| (0,300 %) fällig am 22.04.2016 | | 3.000 | 111 | 0,21 |
| (0,125 %) fällig am 02.09.2016 | | 12.000 | 445 | 0,84 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Erste Abwicklungsanstalt** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.08.2017 | € | 400 | € 408 | 0,77 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.04.2030 | | 800 | 1.090 | 2,06 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 1,625 % fällig am 17.11.2036 | | 200 | 200 | 0,38 |
| 1,850 % fällig am 01.12.2055 | | 200 | 193 | 0,37 |
| **Flemish Community** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2018 | | 700 | 747 | 1,41 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 (b) | | 700 | 1.059 | 2,00 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | | |
| (0,025 %) fällig am 14.10.2016 | | 290 | 290 | 0,55 |
| 0,010 % fällig am 14.12.2016 | | 700 | 700 | 1,32 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 (a) | | 300 | 311 | 0,59 |
| 2,750 % fällig am 15.11.2016 | | 190 | 195 | 0,37 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,033 %) fällig am 22.02.2016 | JPY | 200.000 | 1.531 | 2,89 |
| **Norway Government Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 24.05.2023 | NOK | 2.500 | 274 | 0,52 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.07.2044 | € | 310 | 387 | 0,73 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 28.07.2025 | € | 600 | € 628 | 1,19 |
| 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 300 | 329 | 0,62 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | $ | 400 | 412 | 0,78 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 1,950 % fällig am 30.07.2030 | € | 200 | 191 | 0,36 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 1.200 | 1.310 | 2,48 |
| 4,250 % fällig am 31.10.2016 | | 160 | 166 | 0,31 |
| 4,700 % fällig am 30.07.2041 | | 20 | 26 | 0,05 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | | |
| 0,006 % fällig am 14.10.2016 | | 700 | 700 | 1,32 |
| | | | 14.563 | 27,53 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (c)** | | 52.000 | 5.289 | 10,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€ 48.417** | **91,54** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 17 | € 2 | 0,01 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 18 | 23 | 0,04 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 31 | 14 | 0,03 |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 130 | 13 | 0,02 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 15 | (5) | (0,01) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 6 | 0 | 0,00 |
| | | | | € 47 | 0,09 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 98,875 | 11.03.2016 | 82 | € 11 | € 17 | 0,03 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 160,500 | 22.01.2016 | 5 | € (2) | € (1) | 0,00 |
| Put - Euro-Bobl 5-Year Note February Futures | 131,500 | 22.01.2016 | 19 | (10) | (16) | (0,03) |
| Put - Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | 111,500 | 19.02.2016 | 60 | (8) | (4) | (0,01) |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 82 | (7) | (1) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 82 | (3) | (5) | (0,01) |
| | | | | € (30) | € (27) | (0,05) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 37** | **0,07** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | (5,000 %) | 20.12.2020 | € 3.500 | € (20) | (0,04) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Ultra-Long Duration Fund (Forts.)

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | $ 2.300 | € 2 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 1.300 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 2.900 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 400 | 4 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,250 % | 16.09.2035 | 800 | (21) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.12.2035 | 25.200 | (1.062) | (2,01) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.12.2040 | 15.100 | 71 | 0,13 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.12.2045 | 7.200 | (70) | (0,13) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 700 | (19) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 2,750 % | 17.09.2049 | 1.600 | (357) | (0,67) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | £ 200 | 4 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 21.09.2017 | JPY 2.163.000 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,750 % | 20.12.2024 | 595.000 | (68) | (0,13) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 19.09.2025 | 92.000 | (12) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2044 | 144.000 | 54 | 0,10 |
| | | | | | € (1.469) | (2,77) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (1.489)** | **(2,81)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BPS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,110 % | 22.03.2016 | € 1.200 | € 21 | € 4 | 0,01 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | 500 | 7 | 6 | 0,01 |
| Call - OTC 20-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,200 % | 01.12.2016 | 1.100 | 29 | 20 | 0,04 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | 7.000 | 95 | 87 | 0,16 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 2,620 % | 03.10.2016 | £ 1.000 | 36 | 28 | 0,05 |
| | | | | | | | € 188 | € 145 | 0,27 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | HUS | $ 1,050 | 09.02.2016 | € 300 | € (1) | € (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNY 6,600 | 05.02.2016 | $ 400 | (4) | (2) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 6,600 | 05.02.2016 | 380 | (4) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | CBK | 7,000 | 19.09.2016 | 900 | (12) | (11) | (0,02) |
| | | | | | € (21) | € (16) | (0,03) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BPS | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,990 % | 22.03.2016 | € 400 | € (8) | € (2) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 700 | (6) | (14) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | 1.150 | (38) | (41) | (0,08) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | 2.800 | (97) | (99) | (0,19) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.02.2016 | £ 100 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 600 | (4) | (2) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 600 | (3) | (4) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | HUS | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 01.12.2016 | 600 | (31) | (18) | (0,03) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 300 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.02.2016 | 200 | (5) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 03.10.2016 | 4.900 | (37) | (31) | (0,06) |
| | | | | | | | € (233) | € (211) | (0,40) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2017 | GST | $ 300 | € (10) | € (9) | € (1) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2017 | HUS | 100 | (3) | (3) | 0 | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 200 | (30) | (24) | (6) | (0,06) |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.09.2019 | BOA | 2.700 | 8 | (15) | 23 | 0,02 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.12.2020 | HUS | 1.700 | 1 | (3) | 4 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 400 | 3 | (1) | 4 | 0,01 |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 200 | (5) | (5) | 0 | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 300 | (8) | (8) | 0 | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 500 | (13) | (13) | 0 | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 100 | (3) | (3) | 0 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 200 | (17) | (19) | 2 | (0,03) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | € 100 | (2) | (3) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 100 | (2) | (5) | 3 | 0,00 |
| | | | | | € (80) | € (111) | € 31 | (0,15) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | JPY 39.000 | € 4 | € 3 | € 1 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 97.000 | 9 | 7 | 2 | 0,02 |
| | | | | | € 13 | € 10 | € 3 | 0,02 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 656 | CNH | 4.281 | HUS | € 4 | € (10) | € (6) | (0,01) |
| 01/2016 | CNY | 2.624 | $ | 404 | HUS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | CZK | 5.360 | € | 199 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.340 | DKK | 9.990 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.384 | | 10.330 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 12.713 | € | 1.705 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.678 | | 1.030 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.838 | JPY | 243.000 | CBK | 21 | 0 | 21 | 0,04 |
| 01/2016 | JPY | 243.000 | € | 1.863 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 217 | KRW | 251.853 | BOA | 4 | (6) | (2) | (0,01) |
| 01/2016 | KRW | 485.922 | $ | 418 | FBF | 13 | (9) | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 59 | KRW | 67.992 | GLM | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 225 | MYR | 948 | BOA | 2 | (7) | (5) | (0,01) |
| 01/2016 | MYR | 1.793 | $ | 414 | BPS | 14 | (15) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 58 | MYR | 243 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 628 | € | 429 | BPS | 10 | 0 | 10 | 0,02 |
| 02/2016 | CHF | 103 | | 96 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 308 | | 284 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 3.015 | | 113 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 700 | | 94 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.705 | DKK | 12.710 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 448 | € | 410 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 439 | $ | 478 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 87 | € | 123 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.627 | | 1.507 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 02/2016 | € | 175 | $ | 186 | CBK | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 02/2016 | JPY | 243.000 | € | 1.838 | CBK | 0 | (21) | (21) | (0,04) |
| 02/2016 | € | 76 | £ | 55 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 460 | $ | 501 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 197 | € | 185 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | NOK | 2.695 | | 290 | GLM | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 02/2016 | £ | 3.355 | | 4.726 | JPM | 178 | 0 | 178 | 0,34 |
| 02/2016 | € | 159 | JPY | 21.300 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | NZD | 438 | € | 274 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.646 | | 1.518 | JPM | 13 | (9) | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | SEK | 3.645 | | 392 | JPM | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 32 | | 29 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.267 | | 3.025 | NAB | 20 | 0 | 20 | 0,04 |
| 02/2016 | € | 1.513 | JPY | 200.000 | SCX | 17 | 0 | 17 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 54 | € | 50 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 39 | | 36 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Euro Ultra-Long Duration Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | JPY | 90.000 | $ | 734 | BPS | € 0 | € (14) | € (14) | (0,03) |
| 02/2016 | | 110.000 | | 897 | CBK | 0 | (17) | (17) | (0,03) |
| 02/2016 | SGD | 205 | | 146 | SCX | 4 | (3) | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 5.186 | | 144 | FBF | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 4.634 | | 142 | GLM | 5 | (4) | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 6.642 | | 387 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 04/2016 | CZK | 3.006 | € | 112 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | DKK | 10.330 | | 1.385 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 09/2016 | CZK | 6.009 | | 224 | SOG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 09/2016 | | 6.006 | | 223 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 7.531 | $ | 1.157 | CBK | 41 | (1) | 40 | 0,07 |
| 10/2016 | $ | 488 | CNH | 3.166 | UAG | 11 | (29) | (18) | (0,03) |
| 10/2016 | CZK | 11.111 | € | 417 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 10/2016 | DKK | 2.590 | | 348 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | | 3.816 | | 512 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | | 809 | | 109 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | | 7.167 | | 962 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € 423 | € (172) | € 251 | 0,48 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 102** | **0,19** |
| **Summe Anlagen** | **€ 47.067** | **88,99** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 30 | € 41 | 0,08 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 11 | 7 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 3.833 | 29 | 0,06 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 51 | 47 | 0,09 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 172 | 19 | 0,04 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 38 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 16 | 15 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 15 | 14 | 0,03 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 6 | 4 | 0,01 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 4 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 11 | 8 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 504 | 504 | 0,95 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.614 | 12 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 10 | 13 | 0,03 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 720** | **1,36** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ 5.103** | **9,65** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 52.890** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 386 und Barmittel in Höhe von EUR 3.225 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(c) Der Euro Ultra-Long Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(d) Barmittel in Höhe von EUR 246 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.

**(e) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 5.289 | € 43.128 | € 0 | € 48.417 |
| Finanzderivate[3] | 37 | (1.387) | 0 | (1.350) |
| **Summen** | **€ 5.326** | **€ 41.741** | **€ 0** | **€ 47.067** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 11.054 | € 93.733 | € 138 | € 104.925 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.076 | 0 | 1.076 |
| Finanzderivate[3] | (20) | 20.830 | 0 | 20.810 |
| **Summen** | **€ 11.034** | **€ 115.639** | **€ 138** | **€ 126.811** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(f) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € 1 | € 0 | € 1 |
| BPS | 6 | 0 | 6 |
| BRC | (10) | 0 | (10) |
| CBK | 18 | 0 | 18 |
| DUB | 5 | 0 | 5 |
| FBF | 4 | 0 | 4 |
| GLM | (20) | 0 | (20) |
| GST | (18) | 0 | (18) |
| HUS | (68) | 0 | (68) |
| JPM | 168 | 0 | 168 |
| MSB | 2 | 0 | 2 |
| MYC | (12) | 0 | (12) |
| NAB | 20 | 0 | 20 |
| SCX | 19 | 0 | 19 |
| SOG | 1 | 0 | 1 |
| UAG | (14) | 0 | (14) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(g) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 91,54 | 85,84 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,07 | (0,01) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (2,81) | 17,63 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,19 | (0,59) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,88 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Euro Ultra-Long Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 1,804 % fällig am 01.11.2018 | € | 13.800 | € 14.476 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | | 13.440 | 13.441 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2016 | | 10.800 | 10.796 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 73.600 | 10.038 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| (0,046)% fällig am 14.07.2016 | € | 8.970 | 8.969 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 8.520 | 8.806 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| (0,025)% fällig am 14.10.2016 | | 8.370 | 8.369 |
| **France Government Bond** | | | |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 4.600 | 7.737 |
| **Land Hessen** | | | |
| 3,500 % fällig am 04.01.2016 | | 7.200 | 7.289 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,036 % fällig am 13.02.2017 | | 7.200 | 7.200 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,076 % fällig am 11.12.2015 | | 7.200 | 7.199 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 45.300 | 4.616 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | |
| 3,000 % fällig am 25.02.2016 | € | 6.300 | 6.407 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.10.2015 | | 6.300 | 6.303 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 41.700 | 5.637 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.02.2025 | € | 5.400 | 5.592 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | € | 5.500 | 5.584 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | € | 5.500 | 5.498 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,006 % fällig am 14.10.2016 | € | 5.400 | 5.400 |
| **UBS Group AG** | | | |
| 6,875 % fällig am 29.12.2049 | $ | 6.000 | 5.315 |
| **Portugal Obrigacoes do Tesouro OT** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2025 | € | 4.800 | 4.944 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,051 % fällig am 12.02.2016 | € | 4.700 | 4.697 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,033)% fällig am 22.02.2016 | JPY | 600.000 | 4.539 |
| **Coral Capital Partners, Inc.** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2015 | € | 4.500 | 4.500 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.04.2030 | € | 3.000 | 4.488 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,019)% fällig am 16.11.2015 | JPY | 600.000 | 4.447 |
| **KFW** | | | |
| 1,250 % fällig am 17.10.2019 | € | 4.200 | 4.412 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,137 % fällig am 18.09.2015 | € | 4.300 | 4.296 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 1,804 % fällig am 01.11.2018 | € | 13.800 | € 14.467 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 102.000 | 10.394 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.08.2016 | € | 13.440 | 13.440 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 0,000 % fällig am 17.04.2020 | | 11.700 | 11.722 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2016 | | 10.800 | 10.797 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2015 | DKK | 73.600 | 9.957 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,221 % fällig am 14.04.2015 | € | 9.620 | 9.619 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| (0,046)% fällig am 14.07.2016 | | 8.970 | 8.970 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2016 | | 8.520 | 8.787 |
| **Spain Letras del Tesoro** | | | |
| 0,076 % fällig am 11.12.2015 | | 7.600 | 7.600 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| (0,025)% fällig am 14.10.2016 | | 7.500 | 7.502 |
| **Italy Buoni Ordinari del Tesoro** | | | |
| 0,051 % fällig am 12.02.2016 | | 7.300 | 7.299 |
| **Land Hessen** | | | |
| 3,500 % fällig am 04.01.2016 | | 7.200 | 7.288 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,036 % fällig am 13.02.2017 | | 7.200 | 7.197 |
| **WM Covered Bond Program** | | | |
| 4,000 % fällig am 27.09.2016 | | 6.300 | 6.657 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | |
| 3,000 % fällig am 25.02.2016 | | 6.300 | 6.405 |
| **France Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.10.2015 | | 6.300 | 6.303 |
| **Italy Certificati di Credito del Tesoro** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2016 | | 6.100 | 6.099 |
| **Nykredit Realkredit** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 41.700 | 5.642 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | € | 5.500 | 5.566 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.02.2025 | | 5.400 | 5.368 |
| **UBS Group AG** | | | |
| 6,875 % fällig am 29.12.2049 | | 6.000 | 5.325 |
| **Portugal Obrigacoes do Tesouro OT** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2025 | | 4.800 | 5.269 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | |
| 5,125 % fällig am 30.03.2026 | | 3.600 | 5.029 |
| **France Government Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 25.11.2019 | | 4.800 | 4.918 |

(a) Der Euro Ultra-Long Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Australia Government Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2016 | AUD | 1.100 | $ 810 | 0,11 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 4.400 | 4.807 | 0,68 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | | 325 | 325 | 0,04 |
| **Brazil Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | | 3.550 | 2.387 | 0,34 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 13.05.2023 | | 500 | 440 | 0,06 |
| 5,650 % fällig am 19.03.2022 | | 1.600 | 1.484 | 0,21 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 1.200 | 855 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 200 | 188 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 800 | 576 | 0,08 |
| | | | 6.255 | 0,88 |
| **KANADA** | | | | |
| **Canada Government Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (a) | CAD | 1.540 | 1.356 | 0,19 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 0,933 % fällig am 01.06.2020 | | 843 | 599 | 0,09 |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | | 2.298 | 1.643 | 0,23 |
| 1,133 % fällig am 01.08.2020 | | 785 | 561 | 0,08 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.06.2020 | | 3.100 | 2.223 | 0,31 |
| 2,350 % fällig am 01.06.2025 | | 3.200 | 2.299 | 0,32 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 | | 11.900 | 8.757 | 1,24 |
| 4,200 % fällig am 02.06.2020 | | 1.600 | 1.293 | 0,18 |
| | | | 18.731 | 2,64 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | $ | 667 | 666 | 0,09 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 919 | 211 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 1.339 | 321 | 0,05 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 29.04.2020 | | 150 | 151 | 0,02 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 02.05.2019 | | 1.400 | 1.425 | 0,20 |
| | | | 2.774 | 0,39 |
| **CHINA** | | | | |
| **CNOOC Curtis Funding No.1 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 1.000 | 1.036 | 0,15 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | | 900 | 918 | 0,13 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | | 200 | 207 | 0,03 |
| | | | 2.161 | 0,31 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 1.500 | 1.073 | 0,15 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 40.400 | 1.639 | 0,23 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,550 %) fällig am 12.02.2016 | | 63.000 | 2.533 | 0,36 |
| (0,117 %) fällig am 02.09.2016 | | 180.000 | 7.244 | 1,02 |
| | | | 11.416 | 1,61 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 11.700 | $ 1.729 | 0,24 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 16.224 | 2.341 | 0,33 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.07.2016 | | 201.500 | 29.505 | 4,16 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | | 36.500 | 5.357 | 0,76 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 30.649 | 4.423 | 0,62 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 16.700 | 2.431 | 0,34 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 4.982 | 720 | 0,10 |
| | | | 46.506 | 6,55 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **Finnvera OYJ** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | € | 1.100 | 1.201 | 0,17 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Banque PSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.02.2016 | | 2.000 | 2.185 | 0,31 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | | |
| 3,000 % fällig am 26.10.2020 | $ | 1.900 | 1.978 | 0,28 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 500 | 726 | 0,10 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 1.900 | 2.221 | 0,31 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (a) | | 4.882 | 5.580 | 0,79 |
| 2,500 % fällig am 25.05.2030 | | 3.800 | 4.677 | 0,66 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 600 | 829 | 0,12 |
| | | | 18.196 | 2,57 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **KFW** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 100 | 81 | 0,01 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | | 400 | 308 | 0,04 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 | € | 1.900 | 3.246 | 0,46 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (a)(b) | | 17.877 | 19.918 | 2,81 |
| **Symrise AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 25.10.2017 | | 1.862 | 2.139 | 0,30 |
| | | | 25.692 | 3,62 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 213.000 | 1.594 | 0,22 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | | 61.000 | 489 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 27.000 | 216 | 0,03 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 2.000 | 2.021 | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 70.000 | 535 | 0,08 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 200 | 201 | 0,03 |
| | | | 5.056 | 0,71 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Guernsey I Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | $ | 400 | 413 | 0,06 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | | 4.600 | 4.651 | 0,65 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 14.05.2019 | | 700 | 700 | 0,10 |
| | | | 5.351 | 0,75 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.07.2021 | € | 1.400 | 1.509 | 0,21 |
| 5,250 % fällig am 17.01.2042 | $ | 500 | 453 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2023 | IDR | 8.938.000 | 534 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 13.03.2020 | $ | 200 | 217 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 15.05.2033 | IDR | 3.728.000 | 214 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | $ | 600 | $ 645 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 15.06.2032 | IDR | 55.350.000 | 3.708 | 0,52 |
| 8,375 % fällig am 15.03.2034 | | 51.634.000 | 3.523 | 0,50 |
| | | | 10.803 | 1,52 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Avoca CLO VI PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 16.01.2023 | € | 83 | 90 | 0,01 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 10,000 % fällig am 30.07.2016 | | 5.000 | 5.660 | 0,80 |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 12.875 | 1.488 | 0,21 |
| **Celf Loan Partners IV PLC** | | | | |
| 0,997 % fällig am 03.05.2023 | £ | 1.205 | 1.717 | 0,24 |
| **CELF Loan Partners IV PLC** | | | | |
| 0,925 % fällig am 03.05.2023 | $ | 1.059 | 1.044 | 0,15 |
| **Depfa ACS Bank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | € | 2.800 | 3.138 | 0,44 |
| 4,875 % fällig am 21.05.2019 | | 800 | 1.003 | 0,14 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | | 1.111 | 1.219 | 0,17 |
| **LightPoint Pan-European CLO PLC** | | | | |
| 0,182 % fällig am 31.01.2022 | | 40 | 43 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO China Bond Fund (c)** | | 387.767 | 4.296 | 0,61 |
| | | | 19.698 | 2,78 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.11.2016 | $ | 1.600 | 1.787 | 0,25 |
| 3,875 % fällig am 24.10.2018 | | 1.000 | 1.177 | 0,17 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | | 900 | 984 | 0,14 |
| **Claris ABS Srl** | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | | 3.928 | 4.204 | 0,59 |
| **Creso Srl** | | | | |
| 0,569 % fällig am 30.12.2060 | | 2.812 | 3.034 | 0,43 |
| **F-E Mortgages Srl** | | | | |
| 0,202 % fällig am 15.12.2043 | | 206 | 221 | 0,03 |
| **Giovecca Mortgages SRL** | | | | |
| 0,547 % fällig am 23.04.2048 | | 370 | 400 | 0,06 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (a) | | 4.499 | 5.171 | 0,73 |
| **Mars 2600 Srl** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 1.313 | 1.439 | 0,20 |
| **Republik Italien** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 1.500 | 2.666 | 0,37 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | € | 924 | 998 | 0,14 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 498 | 542 | 0,08 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.06.2019 | £ | 950 | 1.523 | 0,21 |
| | | | 24.146 | 3,40 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 05.03.2018 | $ | 900 | 893 | 0,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 1,700 % fällig am 20.09.2044 | JPY | 20.000 | 184 | 0,03 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,050 %) fällig am 20.01.2016 | | 140.000 | 1.164 | 0,16 |
| (0,031 %) fällig am 14.03.2016 | | 10.490.000 | 87.206 | 12,29 |
| (0,019 %) fällig am 12.01.2016 | | 1.700.000 | 14.132 | 1,99 |
| (0,004 %) fällig am 01.02.2016 | | 60.000 | 499 | 0,07 |
| (0,004 %) fällig am 08.02.2016 | | 1.950.000 | 16.210 | 2,29 |
| | | | 119.395 | 16,83 |
| Summe Japan | | | 120.288 | 16,95 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **LUXEMBURG** | | | | |
| DECO Charlemagne S.A. | | | | |
| 1,450 % fällig am 27.04.2025 | € | 1.490 | $ 1.622 | 0,23 |
| ECAR | | | | |
| 0,852 % fällig am 18.11.2020 | | 212 | 230 | 0,03 |
| Erste Europaische Pfandbrief- und Kommunalkreditbank AG in Luxemburg S.A. | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.01.2016 | $ | 700 | 701 | 0,10 |
| | | | 2.553 | 0,36 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| Malaysia Government International Bond | | | | |
| 3,314 % fällig am 31.10.2017 | MYR | 3.400 | 801 | 0,11 |
| 3,892 % fällig am 15.03.2027 | | 1.900 | 421 | 0,06 |
| 4,378 % fällig am 29.11.2019 | | 2.400 | 578 | 0,08 |
| | | | 1.800 | 0,25 |
| **MEXIKO** | | | | |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 2.300 | 2.093 | 0,30 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | $ | 1.233 | 1.096 | 0,15 |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 1.786 | 1.962 | 0,28 |
| 8,000 % fällig am 11.06.2020 | MXN | 184.000 | 11.735 | 1,65 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | | 7.570 | 483 | 0,07 |
| | | | 17.369 | 2,45 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Cadogan Square CLO III BV | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | € | 310 | 334 | 0,05 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 3.500 | 3.611 | 0,51 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 2.145 | 2.311 | 0,33 |
| Highlander Euro CDO III BV | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | € | 920 | 978 | 0,14 |
| ING Bank NV | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 14.700 | 14.480 | 2,04 |
| Jubilee CDO V BV | | | | |
| 0,282 % fällig am 21.08.2021 | € | 154 | 167 | 0,02 |
| Panther CDO V BV | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | | 394 | 412 | 0,06 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Stichting AK Rabobank Certificaten | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 600.000 | 727 | 0,10 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 300 | 303 | 0,04 |
| | | | 23.323 | 3,29 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| Eksportfinans ASA | | | | |
| 0,720 % fällig am 28.07.2016 | JPY | 300.000 | 2.486 | 0,35 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | $ | 500 | 507 | 0,07 |
| Norway Government Bond | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.000 | 695 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | | 3.700 | 478 | 0,07 |
| | | | 4.166 | 0,59 |
| **POLEN** | | | | |
| Poland Government International Bond | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 9.200 | 2.398 | 0,34 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Banco Espirito Santo S.A. | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | € | 1.700 | 253 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 300 | 45 | 0,01 |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 100 | 97 | 0,01 |
| | | | 395 | 0,06 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Nova Ljubljanska Banka dd | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | | 1.800 | 1.989 | 0,28 |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 3,500 % fällig am 23.03.2017 | € | 417 | $ 474 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 3.400 | 3.583 | 0,50 |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | € | 3.750 | 4.232 | 0,60 |
| 4,750 % fällig am 10.05.2018 | $ | 300 | 319 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 3.300 | 3.648 | 0,51 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 300 | 336 | 0,05 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 5.300 | 6.049 | 0,85 |
| Slovenska izvozna in razvojna banka dd | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | € | 1.200 | 1.322 | 0,19 |
| | | | 21.952 | 3,09 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| South Africa Government International Bond | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.07.2026 | | 600 | 610 | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | $ | 900 | 815 | 0,11 |
| | | | 1.425 | 0,20 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| Export-Import Bank of Korea | | | | |
| 5,125 % fällig am 29.06.2020 | | 300 | 332 | 0,05 |
| Korea Treasury Bond | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.03.2017 | KRW | 2.549.400 | 2.247 | 0,32 |
| 3,750 % fällig am 10.06.2022 | | 1.657.000 | 1.571 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 10.12.2031 | | 573.600 | 613 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 10.09.2018 | | 2.389.900 | 2.293 | 0,32 |
| Republik Korea | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2024 | € | 4.000 | 4.663 | 0,66 |
| | | | 11.719 | 1,65 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 125 | 144 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 1.900 | 2.229 | 0,31 |
| Autonomous Community of Madrid | | | | |
| 1,826 % fällig am 30.04.2025 | | 700 | 752 | 0,11 |
| 4,688 % fällig am 12.03.2020 | | 600 | 755 | 0,11 |
| Autonomous Community of Valencia | | | | |
| 4,000 % fällig am 02.11.2016 | | 2.000 | 2.235 | 0,32 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 1.800 | 1.916 | 0,27 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 3.000 | 3.072 | 0,43 |
| BPE Financiaciones S.A. | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.05.2016 | | 1.000 | 1.096 | 0,15 |
| IM Grupo Banco Popular FTPYME I FTA | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.09.2039 | | 1.118 | 1.204 | 0,17 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 5.450 | 6.123 | 0,86 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 15.750 | 18.680 | 2,63 |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 1.550 | 1.978 | 0,28 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 1.875 | 2.893 | 0,41 |
| Xunta de Galicia | | | | |
| 5,763 % fällig am 03.04.2017 | | 1.200 | 1.392 | 0,20 |
| | | | 44.469 | 6,27 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| Europäischer Stabilitätsmechanismus | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2025 | | 2.600 | 2.869 | 0,40 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| Swedbank AB | | | | |
| 2,200 % fällig am 04.03.2020 | $ | 1.300 | 1.286 | 0,18 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| UBS AG | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 5.550 | 5.807 | 0,82 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Virgin Media Investment Holdings Ltd. | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2023 | | 1.751 | 1.716 | 0,24 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 5.900 | $ 6.730 | 0,95 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 1.900 | 2.031 | 0,29 |
| HBOS PLC | | | | |
| 0,687 % fällig am 01.09.2016 | € | 575 | 625 | 0,09 |
| HSBC Holdings PLC | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 1.200 | 1.315 | 0,18 |
| LBG Capital No.1 PLC | | | | |
| 2,975 % fällig am 12.03.2020 | | 400 | 441 | 0,06 |
| LBG Capital No.2 PLC | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 3.600 | 5.602 | 0,79 |
| Lloyds Bank PLC | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 1.400 | 2.455 | 0,35 |
| 5,125 % fällig am 07.03.2025 | | 3.100 | 5.494 | 0,77 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 700 | 1.083 | 0,15 |
| Pizzaexpress Financing 2 PLC | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2021 | | 400 | 606 | 0,09 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 3.900 | 4.231 | 0,60 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 1.600 | 1.282 | 0,18 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 1.805 | 1.790 | 0,25 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 700 | 1.051 | 0,15 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.07.2019 | € | 2.200 | 2.303 | 0,32 |
| Tesco PLC | | | | |
| 5,000 % fällig am 24.03.2023 | £ | 200 | 289 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 100 | 154 | 0,02 |
| Virgin Media Secured Finance PLC | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 300 | 407 | 0,06 |
| | | | 37.889 | 5,34 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Aggregator of Loans Backed by Assets PLC | | | | |
| 0,755 % fällig am 17.03.2039 | | 2.106 | 2.808 | 0,40 |
| 1,754 % fällig am 24.04.2049 | | 1.894 | 2.764 | 0,39 |
| Auburn Securities 9 PLC | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 1.158 | 1.697 | 0,24 |
| Darrowby No.2 PLC | | | | |
| 2,271 % fällig am 20.02.2044 | | 504 | 751 | 0,11 |
| DECO 12-UK 4 PLC | | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | | 366 | 522 | 0,07 |
| Dukinfield PLC | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | | 2.409 | 3.487 | 0,49 |
| Eurosail-UK PLC | | | | |
| 0,035 % fällig am 13.03.2045 | € | 304 | 313 | 0,04 |
| 0,735 % fällig am 13.03.2045 | £ | 1.300 | 1.819 | 0,26 |
| Great Hall Mortgages No.1 PLC | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 1.297 | 1.223 | 0,17 |
| 0,726 % fällig am 18.06.2039 | £ | 1.097 | 1.493 | 0,21 |
| Great Hall Mortgages PLC | | | | |
| 0,716 % fällig am 18.03.2039 | | 156 | 218 | 0,03 |
| Logistics UK PLC | | | | |
| 1,821 % fällig am 20.08.2025 | | 1.200 | 1.774 | 0,25 |
| Money Partners Securities 4 PLC | | | | |
| 0,963 % fällig am 15.03.2040 | | 41 | 57 | 0,01 |
| Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC | | | | |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 1.234 | 1.661 | 0,23 |
| Residential Mortgage Securities 20 PLC | | | | |
| 0,836 % fällig am 10.08.2038 | | 65 | 88 | 0,01 |
| Residential Mortgage Securities 25 PLC | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | | 299 | 450 | 0,06 |
| Residential Mortgage Securities 28 PLC | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 1.625 | 2.372 | 0,34 |
| ResLoC UK PLC | | | | |
| 0,743 % fällig am 15.12.2043 | | 1.105 | 1.475 | 0,21 |
| | | | 24.972 | 3,52 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (a) | | 6.316 | 9.877 | 1,39 |
| Summe Großbritannien | | | 74.454 | 10,49 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 1,270 % fällig am 25.04.2038 | $ | 202 | $ 201 | 0,03 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 300 | 300 | 0,04 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 2.200 | 2.206 | 0,31 |
| 4,750 % fällig am 10.09.2018 | | 100 | 103 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 200 | 207 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2017 | | 100 | 105 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 3.200 | 3.532 | 0,50 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 253 | 91 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 677 | 358 | 0,05 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 4.500 | 4.489 | 0,63 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | | 500 | 516 | 0,07 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,013 % fällig am 27.04.2018 | | 2.500 | 2.491 | 0,35 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 400 | 442 | 0,06 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 300 | 320 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.10.2020 | | 1.700 | 1.687 | 0,24 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2020 | | 3.400 | 3.333 | 0,47 |
| 4,750 % fällig am 28.09.2017 | AUD | 2.600 | 1.942 | 0,27 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | $ | 997 | 999 | 0,14 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 450 | 475 | 0,07 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 1.400 | 1.038 | 0,15 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **UIL Holdings Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.10.2020 | | 300 | 316 | 0,05 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | | 1.100 | 1.071 | 0,15 |
| | | | 26.221 | 3,70 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.07.2036 | | 406 | 284 | 0,04 |
| 0,722 % fällig am 25.02.2036 | | 200 | 180 | 0,03 |
| 1,082 % fällig am 25.11.2035 | | 1.008 | 866 | 0,12 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | | 69 | 52 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 20.05.2046 (d) | | 71 | 54 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (d) | | 1.003 | 893 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (d) | | 374 | 302 | 0,04 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,882 % fällig am 25.07.2035 | | 1.000 | 966 | 0,14 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,802 % fällig am 25.02.2036 | | 1.778 | 1.215 | 0,17 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 20.10.2036 | | 167 | 131 | 0,02 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,651 % fällig am 17.02.2051 | | 174 | 176 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.12.2036 | | 1.096 | 1.003 | 0,14 |
| 0,622 % fällig am 25.04.2037 (d) | | 398 | 394 | 0,06 |
| 2,934 % fällig am 25.07.2036 | | 145 | 137 | 0,02 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | | 1.100 | 665 | 0,09 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.03.2036 | | 2.500 | 1.924 | 0,27 |
| 0,682 % fällig am 25.06.2037 | | 3.000 | 2.032 | 0,29 |
| 0,832 % fällig am 25.10.2035 | | 1.300 | 1.204 | 0,17 |
| 2,626 % fällig am 25.05.2035 | | 226 | 214 | 0,03 |
| 4,584 % fällig am 25.10.2037 | | 1.832 | 1.700 | 0,24 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,399 % fällig am 25.09.2035 (d) | $ | 1.739 | $ 1.508 | 0,21 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.12.2036 (d) | | 1.764 | 1.591 | 0,22 |
| 0,562 % fällig am 25.06.2037 | | 1.866 | 1.425 | 0,20 |
| 0,562 % fällig am 25.08.2037 | | 2.096 | 1.642 | 0,23 |
| 0,562 % fällig am 25.06.2047 (d) | | 643 | 499 | 0,07 |
| 0,572 % fällig am 25.04.2047 | | 2.692 | 2.320 | 0,33 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | | 1.092 | 1.118 | 0,16 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2046 | | 1.010 | 921 | 0,13 |
| 0,592 % fällig am 25.06.2047 | | 287 | 272 | 0,04 |
| 0,622 % fällig am 25.06.2047 | | 2.343 | 1.711 | 0,24 |
| 0,682 % fällig am 25.12.2036 | | 4.893 | 3.676 | 0,52 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 | | 2.474 | 2.294 | 0,32 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.03.2035 | | 1.151 | 994 | 0,14 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,577 % fällig am 26.02.2036 | | 509 | 493 | 0,07 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | | 1.266 | 1.188 | 0,17 |
| 0,782 % fällig am 25.11.2035 | | 200 | 145 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.08.2037 | | 653 | 334 | 0,05 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.06.2035 | | 719 | 707 | 0,10 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.12.2046 | | 322 | 179 | 0,03 |
| 0,652 % fällig am 25.12.2046 | | 161 | 91 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 645 | 631 | 0,09 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,886 % fällig am 19.07.2035 | | 34 | 33 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 19.06.2036 (d) | | 465 | 291 | 0,04 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 1,517 % fällig am 25.05.2035 | | 1.354 | 1.192 | 0,17 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | | 296 | 127 | 0,02 |
| 0,832 % fällig am 25.01.2036 | | 2.300 | 1.658 | 0,23 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | | 176 | 152 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | | 300 | 263 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.02.2046 | | 669 | 481 | 0,07 |
| 1,222 % fällig am 25.10.2035 | | 1.041 | 977 | 0,14 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | | 500 | 432 | 0,06 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | | 453 | 218 | 0,03 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2037 | | 1.000 | 743 | 0,10 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | | 6.206 | 3.417 | 0,48 |
| **Merrill Lynch Mortgage Trust** | | | | |
| 5,690 % fällig am 12.02.2051 | | 284 | 299 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.10.2036 | | 1.499 | 1.158 | 0,16 |
| 0,552 % fällig am 25.01.2037 | | 3.148 | 1.766 | 0,25 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | | 277 | 183 | 0,03 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | | 2.662 | 1.797 | 0,25 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | | 510 | 266 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,794 % fällig am 15.08.2045 | | 171 | 176 | 0,02 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | | 463 | 405 | 0,06 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 331 | 176 | 0,02 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 1,922 % fällig am 25.09.2047 | | 500 | 411 | 0,06 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,731 % fällig am 25.11.2036 | | 3.060 | 1.660 | 0,23 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 (d) | | 645 | 451 | 0,06 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 387 | 358 | 0,05 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 | | 1.100 | 1.015 | 0,14 |
| 0,692 % fällig am 25.05.2037 | $ | 200 | $ 184 | 0,03 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | | 200 | 172 | 0,02 |
| 0,822 % fällig am 25.12.2035 | | 2.000 | 1.922 | 0,27 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | | 800 | 623 | 0,09 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 2.661 | 2.410 | 0,34 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.05.2036 | | 660 | 381 | 0,05 |
| 0,692 % fällig am 25.03.2036 | | 305 | 248 | 0,04 |
| 1,082 % fällig am 25.08.2035 (d) | | 2.200 | 1.391 | 0,20 |
| 1,382 % fällig am 25.01.2036 (d) | | 164 | 136 | 0,02 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,387 % fällig am 20.01.2047 (d) | | 67 | 55 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | | 2.000 | 1.223 | 0,17 |
| 0,702 % fällig am 25.05.2036 | | 1.000 | 803 | 0,11 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,642 % fällig am 25.05.2037 | | 103 | 85 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.10.2035 | | 607 | 506 | 0,07 |
| 2,655 % fällig am 25.10.2036 (d) | | 196 | 146 | 0,02 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 266 | 213 | 0,03 |
| 1,472 % fällig am 25.08.2033 | | 87 | 80 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2046 | | 1.478 | 1.181 | 0,17 |
| 0,622 % fällig am 25.05.2036 | | 615 | 462 | 0,07 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2036 | | 91 | 65 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,242 % fällig am 19.10.2033 | | 7 | 6 | 0,00 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,082 % fällig am 25.10.2035 | | 1.500 | 1.426 | 0,20 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.11.2045 | | 446 | 392 | 0,06 |
| 1,657 % fällig am 25.06.2042 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,824 % fällig am 25.12.2036 (d) | | 223 | 203 | 0,03 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (d) | | 1.545 | 1.380 | 0,19 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.01.2037 | | 2.500 | 1.738 | 0,25 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,762 % fällig am 25.09.2034 | | 24 | 24 | 0,00 |
| | | | 75.697 | 10,67 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,334 % fällig am 15.02.2028 | | 1.300 | 1.654 | 0,23 |
| **Los Angeles, California, Metropolitan Water District of Southern California Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 6,947 % fällig am 01.07.2040 | | 600 | 699 | 0,10 |
| **New York, New York, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | | |
| 6,646 % fällig am 01.12.2031 | | 1.300 | 1.509 | 0,21 |
| **New York, New York, Municipal Water Finance Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 5,440 % fällig am 15.06.2043 | | 750 | 917 | 0,13 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,950 % fällig am 01.03.2036 | | 950 | 1.137 | 0,16 |
| | | | 5.916 | 0,83 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.08.2043 | | 3.990 | 4.000 | 0,56 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2043 | | 172 | 178 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2040 - 01.11.2040 | | 1.357 | 1.440 | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2041 | | 341 | 369 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039 | | 946 | 1.054 | 0,15 |
| **Fannie Mae TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | | 11.000 | 11.001 | 1,55 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 | | 19.400 | 20.017 | 2,82 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Freddie Mac TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ 3.000 | $ 2.995 | 0,42 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | 4.600 | 4.726 | 0,67 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 | 1.100 | 1.147 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 20.01.2046 | 2.600 | 2.761 | 0,39 |
| **Tennessee Valley Authority** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2039 | 25 | 30 | 0,01 |
| | | 49.718 | 7,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)(e)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 - 15.07.2024 (f)(g) | $ 32.428 | $ 31.323 | 4,41 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 22.995 | 21.970 | 3,10 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 10.932 | 10.592 | 1,49 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (f)(g) | 12.037 | 13.699 | 1,93 |
| | | 77.584 | 10,93 |
| Summe USA | | 235.337 | 33,17 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 314.757 | $ 3.148 | 0,44 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 779.847** | **109,90** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 25 | $ (18) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 23 | (10) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 19 | (15) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 31 | (18) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 70 | 24 | 0,00 |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 901 | (609) | (0,09) |
| Euro-BONO Spanish Government Bond March Futures | Long | 03/2016 | 25 | (82) | (0,01) |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 39 | 40 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 507 | 1.198 | 0,17 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 66 | 210 | 0,03 |
| Euro-OAT March Futures | Long | 03/2016 | 74 | (62) | (0,01) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 516 | 112 | 0,02 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 7 | 2 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 435 | (132) | (0,02) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.006 | (358) | (0,05) |
| | | | | $ 282 | 0,04 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | € 170,000 | 19.02.2016 | 533 | $ 6 | $ 6 | 0,00 |
| Call - Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | 112,600 | 19.02.2016 | 433 | 3 | 2 | 0,00 |
| Put - Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | 125,250 | 19.02.2016 | 901 | 5 | 5 | 0,00 |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 108,000 | 19.02.2016 | 1.045 | 9 | 16 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 435 | 4 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 27 | $ 33 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 315** | **0,04** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Senior Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | € 4.700 | $ (9) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 28.215 | $ (579) | (0,08) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 33.800 | 0 | 0,00 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 19.200 | (60) | (0,01) |
| iTraxx Europe Senior Financials Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 19.600 | (73) | (0,01) |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 13.300 | 18 | 0,00 |
| | | | | $ (694) | (0,10) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,970 % | 13.02.2016 | £ 35.400 | $ (187) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,950 % | 19.02.2016 | 32.400 | (165) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,013 % | 23.01.2025 | SEK 9.700 | (36) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,023 % | 23.01.2025 | 8.000 | (29) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,033 % | 23.01.2025 | 26.500 | (71) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,036 % | 23.01.2025 | 9.400 | (33) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | $ 184.800 | (257) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | 87.200 | (247) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 31.08.2022 | 24.100 | (52) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,038 % | 31.08.2022 | 9.900 | (65) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 93.400 | (2.320) | (0,33) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 13.01.2023 | 6.900 | (117) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 63.200 | 206 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 15.06.2046 | 16.000 | (77) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.06.2026 | AUD 1.600 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 300 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 7.800 | (84) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 53.500 | (212) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 2.800 | 39 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 12.800 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.09.2018 | 19.700 | (211) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 3.500 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 5.500 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 1.800 | (104) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 22.03.2018 | JPY 13.400.000 | 47 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 % | 18.09.2020 | 910.000 | (259) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 18.12.2025 | 270.000 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,250 % | 17.06.2035 | 410.000 | 107 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2045 | 810.000 | 215 | 0,03 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,340 % | 28.09.2017 | MXN 98.000 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,195 % | 05.10.2017 | 75.800 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,130 % | 17.10.2017 | 220.800 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,260 % | 31.10.2017 | 157.700 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,610 % | 07.07.2021 | 270.600 | (114) | (0,02) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 11.10.2021 | 2.700 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,715 % | 15.10.2021 | 164.100 | (103) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,620 % | 09.11.2021 | 19.000 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,560 % | 11.11.2021 | 900 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 18.07.2022 | 22.900 | 7 | 0,00 |
| | | | | | $ (4.157) | (0,58) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (4.860)** | **(0,68)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 900 | $ 40 | $ 48 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 4.700 | 205 | 250 | 0,04 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNY 6,520 | 31.10.2016 | 349 | 107 | 244 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 125,100 | 27.01.2016 | 3.800 | 27 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 379 | $ 543 | 0,08 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | GST | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | € 14.000 | $ 210 | $ 189 | 0,03 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 3.600 | $ (6) | $ (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 5.700 | (11) | (5) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 1.900 | (4) | (2) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | GST | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 6.200 | (4) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | GST | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 6.200 | (12) | (9) | 0,00 |
| | | | | | | $ (37) | $ (19) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 900 | $ (19) | $ (23) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,300 | 28.03.2016 | 4.700 | (97) | (121) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNY 6,600 | 05.02.2016 | 2.000 | (22) | (13) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 6,600 | 05.02.2016 | 1.760 | (20) | (11) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | AZD | 7,000 | 01.11.2016 | 2.400 | (28) | (38) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 7,000 | 01.11.2016 | 6.100 | (73) | (98) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | MSB | RUB 70,000 | 02.02.2016 | 1.000 | (18) | (53) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | CBK | 71,500 | 09.03.2016 | 800 | (17) | (43) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 3,800 | 28.03.2016 | 900 | (18) | (14) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 4.700 | (100) | (72) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 117,350 | 27.01.2016 | 7.600 | (54) | (14) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.082,500 | 19.01.2016 | 1.700 | (13) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | GLM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 600 | (5) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 1.900 | (15) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (499) | $ (500) | (0,07) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 0,400 % | 29.04.2016 | € 9.100 | $ (34) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 9.100 | (79) | (194) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GST | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,493 % | 01.09.2016 | 5.600 | (210) | (238) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 5.000 | (87) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 5.000 | (80) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 6.650 | (52) | (21) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 6.650 | (36) | (42) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 7.900 | (58) | (8) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 01.02.2016 | 7.900 | (53) | (7) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (689) | $ (511) | (0,07) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 216,687 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 07.04.2020 | $ 500 | $ (4) | $ 0 | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | DUB | 218,011 | Maximal [-(Final Index/Initial Index -1), 0] | 13.10.2020 | 400 | (4) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (8) | $ 0 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | BPS | $ 500 | $ 0 | $ 1 | $ (1) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | CBK | 1.300 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (2) | $ 1 | $ (3) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BOA | $ 4.500 | $ (563) | $ (124) | $ (439) | (0,08) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 4.900 | (613) | (137) | (476) | (0,09) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | HUS | 100 | (13) | (3) | (10) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 800 | (4) | (5) | 1 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.12.2016 | FBF | 200 | 1 | (20) | 21 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 100 | 0 | (3) | 3 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.06.2016 | UAG | 600 | 2 | (12) | 14 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BOA | 1.800 | 4 | (14) | 18 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BRC | 1.800 | 4 | (12) | 16 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | CBK | 1.300 | 3 | (12) | 15 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | CBK | 300 | 1 | (1) | 2 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | GST | 6.700 | 16 | (60) | 76 | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | GST | $ 600 | $ 1 | $ (3) | $ 4 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | HUS | 800 | 2 | (5) | 7 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | JPM | 2.500 | 6 | (19) | 25 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | JPM | 700 | 1 | (4) | 5 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | MYC | 1.000 | 2 | (8) | 10 | 0,00 |
| Greece Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | BRC | 400 | (31) | (22) | (9) | 0,00 |
| Greece Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 500 | (75) | (38) | (37) | (0,01) |
| Greece Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | GST | 1.300 | (102) | (130) | 28 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BOA | 3.200 | (103) | (61) | (42) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BPS | 4.500 | (145) | (86) | (59) | (0,02) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | 2.400 | (67) | (31) | (36) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | DUB | 1.300 | (42) | (26) | (16) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2021 | FBF | 500 | (36) | (33) | (3) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 3.000 | 6 | (49) | 55 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 2.100 | (68) | (41) | (27) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | JPM | 1.300 | (36) | (16) | (20) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | JPM | 7.500 | (294) | (247) | (47) | (0,04) |
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 4.000 | (97) | (94) | (3) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.09.2019 | BPS | 3.700 | (970) | (190) | (780) | (0,14) |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 1.500 | 10 | (4) | 14 | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | BOA | 3.600 | (246) | (100) | (146) | (0,03) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | BOA | 7.500 | (611) | (339) | (272) | (0,09) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BPS | 1.900 | (106) | (88) | (18) | (0,01) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | 12.000 | (892) | (492) | (400) | (0,13) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 1.300 | (73) | (60) | (13) | (0,01) |
| Teck Resources Ltd. | 1,000 % | 20.03.2016 | CBK | 300 | (5) | (1) | (4) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | € 200 | (19) | (17) | (2) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 1.000 | (93) | (85) | (8) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 700 | (65) | (55) | (10) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 300 | (28) | (24) | (4) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 800 | (1) | (7) | 6 | 0,00 |
| | | | | | $ (5.339) | $ (2.778) | $ (2.561) | (0,75) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | BRC | € 1.300 | $ 37 | $ 28 | $ 9 | 0,00 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BOA | € 18.400 | $ 20.185 | $ 176 | $ (60) | $ 236 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | BOA | 2.170 | 2.352 | 36 | 6 | 30 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | BOA | 4.400 | 4.686 | 40 | (21) | 61 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.12.2020 | BPS | 11.500 | 12.466 | 154 | 15 | 139 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BPS | 10.474 | 11.490 | 127 | (7) | 134 | 0,02 |

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | CBK | € 1.300 | $ 1.426 | $ 12 | $ (5) | $ 17 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | CBK | 18.070 | 19.588 | 470 | 221 | 249 | 0,07 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | DUB | 20.400 | 22.379 | 247 | (15) | 262 | 0,03 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | DUB | 2.500 | 2.653 | 32 | (3) | 35 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | GLM | 2.400 | 2.602 | 71 | 38 | 33 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month JPY-LIBOR abzgl. 0,908 % basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | MYC | $ 2.703 | JPY 330.000 | (16) | (25) | 9 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.349 | $ 144 | $ 1.205 | 0,19 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 17.09.2019 | BRC | ZAR 55.000 | $ (138) | $ (11) | $ (127) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-SAJIBOR | 7,500 % | 17.09.2019 | GST | 21.800 | (55) | 0 | (55) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | JPM | BRL 12.500 | (22) | (2) | (20) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | HUS | 47.400 | 89 | 71 | 18 | 0,01 |
| | | | | | | $ (126) | $ 58 | $ (184) | (0,02) |

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 16.08.2016 | DUB | CHF 19 | $ 32 | $ 0 | $ 32 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,085 % | 16.08.2016 | DUB | 9 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,087 % | 16.08.2016 | DUB | 19 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,088 % | 16.08.2016 | DUB | 7 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,090 % | 16.08.2016 | DUB | 9 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 06.12.2016 | DUB | 5 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,103 % | 16.08.2016 | DUB | (9) | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,105 % | 16.08.2016 | DUB | (9) | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,106 % | 16.08.2016 | DUB | (19) | (4) | 0 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,109 % | 16.08.2016 | DUB | (10) | (9) | 0 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,112 % | 16.08.2016 | DUB | (16) | (18) | 0 | (18) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,108 % | 06.12.2016 | DUB | (5) | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 94 | $ 0 | $ 94 | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 5.576 | BRL | 21.775 | BOA | $ 0 | $ (72) | $ (72) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 21.775 | $ | 6.971 | BOA | 1.469 | (2) | 1.467 | 0,21 |
| 01/2016 | $ | 5.306 | BRL | 20.730 | BPS | 0 | (66) | (66) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 20.730 | $ | 5.309 | BPS | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| 01/2016 | | 18.472 | | 4.677 | BRC | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.731 | BRL | 18.472 | BRC | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 2.820 | $ | 722 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 726 | BRL | 2.820 | CBK | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 100.129 | $ | 25.576 | DUB | 267 | 0 | 267 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 26.296 | BRL | 100.129 | DUB | 0 | (987) | (987) | (0,14) |
| 01/2016 | | 2.625 | | 10.166 | FBF | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 10.166 | $ | 2.603 | FBF | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | | 44.217 | | 12.355 | JPM | 1.179 | 0 | 1.179 | 0,17 |
| 01/2016 | $ | 11.480 | BRL | 44.217 | JPM | 0 | (303) | (303) | (0,04) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 930 | BRL | 3.632 | UAG | $ 0 | $ (12) | $ (12) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 3.632 | $ | 941 | UAG | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 296 | CNH | 1.887 | CBK | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.203 | CNY | 33.409 | DUB | 0 | (99) | (99) | (0,01) |
| 01/2016 | | 1.985 | DKK | 12.775 | HUS | 0 | (125) | (125) | (0,02) |
| 01/2016 | DKK | 7.867 | $ | 1.200 | JPM | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| 01/2016 | | 10.282 | | 1.574 | MSB | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 56 | € | 52 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 5 | $ | 5 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | IDR | 2.035.240 | | 146 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.315.700 | | 166 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 26.741 | INR | 1.775.934 | CBK | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.050 | | 271.022 | JPM | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 272.938 | $ | 4.108 | JPM | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 185.721 | | 2.797 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 38.328 | | 577 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 247.577 | | 3.726 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 270.000 | | 2.198 | BOA | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| 01/2016 | | 140.000 | | 1.151 | BPS | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.670.000 | | 29.859 | JPM | 0 | (652) | (652) | (0,09) |
| 01/2016 | $ | 955 | KRW | 1.127.282 | BPS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 510 | | 583.644 | BRC | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 472 | | 547.284 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.147 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 592.626 | | 516 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 530.239 | | 463 | FBF | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 150 | KRW | 169.871 | GLM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 475 | | 537.700 | JPM | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.570 | | 13.584.429 | JPM | 9 | (25) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.089.302 | $ | 943 | JPM | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.596.471 | | 2.249 | SOG | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 650 | KRW | 748.020 | UAG | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.820 | MYR | 7.517 | AZD | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| 01/2016 | MYR | 17.103 | $ | 3.950 | BPS | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.163 | MYR | 4.938 | BRC | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 5.147 | $ | 1.190 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 523 | MYR | 2.196 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 1.859 | $ | 431 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.790 | MYR | 7.664 | SOG | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.321 | | 5.489 | UAG | 0 | (49) | (49) | (0,01) |
| 01/2016 | | 4.652 | PHP | 218.997 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 496 | | 23.471 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 39.452 | $ | 585 | JPM | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 557 | RUB | 39.452 | MSB | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | | 617 | TRY | 1.802 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.036 | | 20.766 | SCX | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 3.791 | $ | 2.751 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 59.109 | | 15.058 | BPS | 269 | 0 | 269 | 0,04 |
| 02/2016 | $ | 6.078 | BRL | 24.055 | CBK | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| 02/2016 | | 24.783 | | 98.004 | DUB | 0 | (263) | (263) | (0,04) |
| 02/2016 | | 4 | | 16 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 931 | | 3.632 | UAG | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 11.850 | $ | 8.893 | JPM | 361 | 0 | 361 | 0,05 |
| 02/2016 | $ | 15.295 | CAD | 20.367 | MSB | 0 | (632) | (632) | (0,09) |
| 02/2016 | | 9.145 | CHF | 9.130 | DUB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.096 | COP | 17.895.203 | HUS | 0 | (482) | (482) | (0,07) |
| 02/2016 | | 4.043 | CZK | 101.597 | CBK | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| 02/2016 | CZK | 63.151 | $ | 2.620 | CBK | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 480 | CZK | 12.229 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.769 | DKK | 12.070 | CBK | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 47.420 | $ | 6.852 | HUS | 0 | (58) | (58) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 677 | DKK | 4.750 | JPM | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 8.342 | $ | 8.921 | CBK | 0 | (149) | (149) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 37.971 | € | 35.006 | CBK | 159 | (68) | 91 | 0,01 |
| 02/2016 | | 15.162 | | 14.211 | JPM | 312 | (22) | 290 | 0,04 |
| 02/2016 | € | 66.534 | $ | 71.708 | JPM | 14 | (650) | (636) | (0,09) |
| 02/2016 | $ | 1.647 | € | 1.500 | MSB | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | | 15.055 | | 14.136 | SCX | 315 | 0 | 315 | 0,04 |
| 02/2016 | £ | 1.768 | $ | 2.666 | CBK | 59 | 0 | 59 | 0,01 |
| 02/2016 | | 20.441 | | 30.875 | HUS | 745 | 0 | 745 | 0,10 |
| 02/2016 | $ | 3.143 | £ | 2.084 | JPM | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| 02/2016 | | 5.158 | HKD | 39.963 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 131 | IDR | 1.826.550 | AZD | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 12.940.079 | $ | 924 | AZD | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.916.180 | | 204 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 21 | IDR | 299.897 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 1.154.800 | $ | 80 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 5.809 | ILS | 22.531 | DUB | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | | 471 | | 1.821 | GLM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 2.739 | $ | 707 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 145.222 | | 2.148 | BRC | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.234 | JPY | 273.300 | CBK | 40 | 0 | 40 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ | 13.092 | JPY | 1.611.800 | JPM | $ 318 | $ 0 | $ 318 | 0,04 |
| 02/2016 | | 28.777 | | 3.539.600 | MSB | 672 | 0 | 672 | 0,09 |
| 02/2016 | NOK | 2.060 | $ | 239 | HUS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.940 | NZD | 2.894 | BOA | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 02/2016 | NZD | 4.440 | $ | 2.935 | BOA | 0 | (97) | (97) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 2.154 | SEK | 18.720 | BOA | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| 02/2016 | | 2.358 | | 20.425 | CBK | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| 02/2016 | | 4.968 | SGD | 7.008 | HUS | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 2.049 | $ | 1.447 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.074 | | 759 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 5.734 | THB | 205.836 | BOA | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 27.888 | $ | 840 | BRC | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 747 | TWD | 24.379 | GLM | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | | 547 | | 18.073 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.914 | | 258.024 | JPM | 0 | (95) | (95) | (0,01) |
| 02/2016 | TWD | 23.369 | $ | 706 | SOG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | JPY | 930.000 | | 7.654 | BPS | 0 | (90) | (90) | (0,01) |
| 03/2016 | | 9.020.000 | | 74.444 | HUS | 0 | (662) | (662) | (0,09) |
| 03/2016 | $ | 420 | MXN | 7.262 | BRC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | | 10.281 | | 176.289 | GLM | 0 | (125) | (125) | (0,02) |
| 03/2016 | | 114 | | 1.955 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | | 3.499 | PEN | 11.731 | BRC | 0 | (96) | (96) | (0,01) |
| 03/2016 | | 435 | | 1.492 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | | 3.878 | RON | 15.981 | SOG | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| 04/2016 | BRL | 7.576 | $ | 2.182 | CBK | 325 | 0 | 325 | 0,05 |
| 04/2016 | | 36.603 | | 10.753 | DUB | 1.783 | 0 | 1.783 | 0,25 |
| 04/2016 | | 29.227 | | 8.724 | GLM | 1.562 | 0 | 1.562 | 0,22 |
| 04/2016 | $ | 5.187 | CLP | 3.689.131 | HUS | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| 04/2016 | RUB | 39.452 | $ | 544 | MSB | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 24.683 | | 7.070 | CBK | 1.077 | 0 | 1.077 | 0,15 |
| 05/2016 | $ | 8.378 | PLN | 33.264 | DUB | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 05/2016 | | 7.508 | ZAR | 112.696 | BOA | 0 | (410) | (410) | (0,06) |
| 07/2016 | BRL | 378 | $ | 105 | GLM | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 07/2016 | DKK | 14.850 | | 2.243 | BOA | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| 07/2016 | | 71.200 | | 10.945 | DUB | 517 | 0 | 517 | 0,07 |
| 07/2016 | | 116.048 | | 17.686 | UAG | 688 | 0 | 688 | 0,10 |
| 09/2016 | CNH | 30.745 | | 4.652 | BPS | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| 09/2016 | | 13.202 | | 1.985 | BRC | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 09/2016 | | 6.598 | | 992 | CBK | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 09/2016 | | 6.596 | | 992 | HUS | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 09/2016 | $ | 4.047 | CNH | 26.396 | JPM | 0 | (133) | (133) | (0,02) |
| 09/2016 | CNH | 57.469 | $ | 8.694 | JPM | 179 | 0 | 179 | 0,03 |
| 09/2016 | | 11.725 | | 1.774 | UAG | 37 | 0 | 37 | 0,01 |
| 09/2016 | $ | 14.778 | CNH | 96.432 | UAG | 0 | (489) | (489) | (0,07) |
| 09/2016 | CZK | 180.210 | $ | 7.593 | HUS | 265 | 0 | 265 | 0,04 |
| 10/2016 | | 40.821 | | 1.724 | JPM | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| 10/2016 | DKK | 48.230 | | 7.372 | JPM | 280 | 0 | 280 | 0,04 |
| | | | | | | $ 14.122 | $ (7.748) | $ 6.374 | 0,90 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 2.089** | **0,29** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae TBA (i)** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | $ (7.200) | $ (7.620) | (1,07) |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | (4.800) | (5.176) | (0,73) |
| | | $ (12.796) | (1,80) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (12.796)** | **(1,80)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ 3.100 | $ 3.102 | 0,44 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 3.102** | **0,44** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 767.697** | **108,19** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | |
| **ANZ National Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD 140 | $ 102 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ 288 | 425 | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ 43 | 43 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY 24.693 | 205 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ 1.185 | 1.185 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | $ 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 17 | 12 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 244 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 18 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 118 | 14 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 13 | 13 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 41 | 3 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 370 | 370 | 0,05 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 53 | 53 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 193 | 12 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 356 | 356 | 0,05 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 82 | 60 | 0,01 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 190 | 22 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 587 | 423 | 0,06 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 767 | 833 | 0,12 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 91 | 134 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 10.400 | 86 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 4.372** | **0,62** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (62.498)** | **(8,81)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 709.571** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 10.040 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(c) **Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 28.972 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.094 und Barmittel in Höhe von USD 2.545 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(g) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.247 und Barmittel in Höhe von USD 672 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(h) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 3.390 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(i) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(j) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 8.171 | $ 771.676 | $ 0 | $ 779.847 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 3.102 | 0 | 3.102 |
| Finanzderivate[3] | 315 | (2.771) | 0 | (2.456) |
| Leerverkäufe | 0 | (12.796) | 0 | (12.796) |
| **Summen** | **$ 8.486** | **$ 759.211** | **$ 0** | **$ 767.697** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 23.025 | $ 616.980 | $ 218 | $ 640.223 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 3.106 | 0 | 3.106 |
| Finanzderivate[3] | (751) | (8.934) | 0 | (9.685) |
| **Summen** | **$ 22.274** | **$ 611.152** | **$ 218** | **$ 633.644** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(k) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 1 | AUD | 2 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 2 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.762 | | 2.423 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.427 | $ | 1.746 | NAB | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | CAD | 4 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.075 | | 5.660 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 5.665 | $ | 4.251 | JPM | 173 | 0 | 173 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1 | CAD | 1 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 10 | $ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.250 | | 2.248 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.712 | | 11.847 | CBK | 147 | 0 | 147 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 799 | CHF | 796 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 29.696 | | 30.320 | DUB | 593 | 0 | 593 | 0,08 |
| 01/2016 | | 39 | | 40 | FBF | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 2 | $ | 2 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 21.346 | CHF | 21.803 | JPM | 435 | 0 | 435 | 0,06 |
| 01/2016 | CHF | 22.663 | $ | 22.945 | JPM | 305 | 0 | 305 | 0,04 |
| 01/2016 | | 18.432 | | 18.608 | MSB | 194 | 0 | 194 | 0,03 |
| 01/2016 | | 15 | | 15 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 29.343 | | 29.706 | UAG | 392 | 0 | 392 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 29.857 | CHF | 30.320 | UAG | 433 | 0 | 433 | 0,06 |
| 01/2016 | DKK | 3.330 | $ | 475 | SCX | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 24.888 | € | 22.650 | BOA | 0 | (283) | (283) | (0,04) |
| 01/2016 | | 399 | | 375 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | | 45 | | 41 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 23.066 | $ | 24.581 | HUS | 0 | (476) | (476) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 4 | € | 4 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | £ | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | | 2 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 2.470 | $ | 3.724 | MSB | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3.650 | £ | 2.466 | SCX | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | JPY | 123 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 895 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 841 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 1.048.559 | $ | 8.584 | GLM | 0 | (132) | (132) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 8.650 | JPY | 1.046.672 | MSB | 51 | 0 | 51 | 0,01 |
| 01/2016 | | 2 | | 188 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 0 | | 28 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 1.544 | $ | 178 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 78 | | 52 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 6.605 | | 757 | BOA | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | AUD | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 2.423 | $ | 1.759 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2 | CAD | 3 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 5.655 | $ | 4.072 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 39 | | 39 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 11.725 | CHF | 11.576 | CBK | 0 | (146) | (146) | (0,02) |
| 02/2016 | | 22.973 | | 22.663 | JPM | 0 | (305) | (305) | (0,04) |
| 02/2016 | | 18.630 | | 18.432 | MSB | 0 | (194) | (194) | (0,03) |
| 02/2016 | | 29.740 | | 29.343 | UAG | 0 | (390) | (390) | (0,05) |
| 02/2016 | € | 22.650 | $ | 24.906 | BOA | 283 | 0 | 283 | 0,04 |
| 02/2016 | $ | 12 | € | 11 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 2.466 | $ | 3.650 | SCX | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | £ | 1 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4 | JPY | 486 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 1.046.672 | $ | 8.655 | MSB | 0 | (51) | (51) | (0,01) |
| | | | | | | $ 3.121 | $ (2.055) | $ 1.066 | 0,15 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional DKK (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 1.396 | AUD | 1.920 | JPM | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1.920 | $ | 1.381 | NAB | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.239 | CAD | 4.498 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 4.498 | $ | 3.376 | JPM | 137 | 0 | 137 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 858 | | 838 | FBF | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 23.432 | DKK | 164.910 | BOA | 573 | 0 | 573 | 0,08 |
| 01/2016 | DKK | 161.741 | $ | 23.673 | BOA | 129 | 0 | 129 | 0,02 |
| 01/2016 | | 10.120 | | 1.473 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 17.491 | DKK | 123.089 | HUS | 426 | 0 | 426 | 0,06 |
| 01/2016 | DKK | 161.741 | $ | 23.702 | JPM | 158 | 0 | 158 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 23.418 | DKK | 164.910 | SCX | 587 | 0 | 587 | 0,08 |
| 01/2016 | | 727 | | 4.956 | SOG | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 19.732 | € | 17.958 | BOA | 0 | (224) | (224) | (0,03) |
| 01/2016 | | 242 | | 228 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 18.185 | $ | 19.380 | HUS | 0 | (375) | (375) | (0,05) |
| 01/2016 | $ | 2.915 | £ | 1.964 | JPM | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.964 | $ | 2.961 | MSB | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 860.377 | | 7.044 | GLM | 0 | (109) | (109) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 7.111 | JPY | 860.377 | MSB | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| 01/2016 | NOK | 1.111 | $ | 128 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 4.748 | | 548 | CBK | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.920 | | 1.394 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 4.498 | | 3.239 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 23.691 | DKK | 161.741 | BOA | 0 | (128) | (128) | (0,02) |
| 02/2016 | | 23.719 | | 161.741 | JPM | 0 | (157) | (157) | (0,02) |
| 02/2016 | € | 17.958 | $ | 19.746 | BOA | 225 | 0 | 225 | 0,03 |
| 02/2016 | £ | 1.964 | | 2.915 | JPM | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 860.377 | | 7.115 | MSB | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | | | | | | $ 2.373 | $ (1.112) | $ 1.261 | 0,18 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Partially Hedged) Class, Class E EUR (Partially Hedged) und Investor EUR (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 5 | AUD | 7 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4 | | 5 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 31 | $ | 22 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.173 | AUD | 8.491 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 8.480 | $ | 6.101 | NAB | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 6 | AUD | 9 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12 | CAD | 16 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14.844 | | 20.615 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9 | | 12 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 20.583 | $ | 15.447 | JPM | 629 | 0 | 629 | 0,09 |
| 01/2016 | $ | 1 | CAD | 1 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 3 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 62 | $ | 45 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 5.367 | | 5.227 | BOA | 0 | (134) | (134) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 5.434 | CHF | 5.367 | JPM | 0 | (72) | (72) | (0,01) |
| 01/2016 | DKK | 8.861 | $ | 1.259 | HUS | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 101.796 | € | 95.477 | BOA | 1.920 | 0 | 1.920 | 0,27 |
| 01/2016 | € | 92.938 | $ | 102.119 | BOA | 1.161 | 0 | 1.161 | 0,16 |
| 01/2016 | $ | 4.609 | € | 4.248 | BPS | 27 | (22) | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 14 | $ | 15 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.431 | | 5.899 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 215 | | 234 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 697 | € | 642 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 17 | $ | 18 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 107.455 | € | 100.833 | HUS | 2.080 | 0 | 2.080 | 0,29 |
| 01/2016 | € | 8.510 | $ | 9.352 | HUS | 108 | 0 | 108 | 0,02 |
| 01/2016 | | 56 | | 59 | NAB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | € | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 99.476 | | 108.656 | UAG | 596 | (1) | 595 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 5 | £ | 3 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 29 | | 19 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 43 | $ | 64 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | £ | 2 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6 | | 4 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | | 2 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 8.956 | $ | 13.502 | MSB | 302 | 0 | 302 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 13.274 | £ | 8.969 | SCX | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| 01/2016 | | 3 | | 2 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 34 | JPY | 4.141 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 190 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23 | | 2.732 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 162 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | JPY | 3.661.842 | $ | 29.978 | GLM | $ 0 | $ (462) | $ (462) | (0,06) |
| 01/2016 | $ | 30.308 | JPY | 3.667.188 | MSB | 177 | 0 | 177 | 0,03 |
| 01/2016 | JPY | 53 | $ | 0 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 0 | JPY | 21 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 22 | | 2.730 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 14.747 | $ | 120 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 3.965 | | 458 | CBK | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 32 | NZD | 48 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 17.945 | $ | 2.058 | BOA | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 2.153 | SEK | 17.945 | CBK | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1 | AUD | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 8.491 | $ | 6.165 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | CAD | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 20.602 | $ | 14.836 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 5.367 | | 5.441 | JPM | 72 | 0 | 72 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 102.148 | € | 92.898 | BOA | 0 | (1.162) | (1.162) | (0,16) |
| 02/2016 | € | 21 | $ | 23 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.359 | € | 8.510 | HUS | 0 | (108) | (108) | (0,02) |
| 02/2016 | | 108.607 | | 99.360 | UAG | 0 | (596) | (596) | (0,08) |
| 02/2016 | £ | 8.969 | $ | 13.275 | SCX | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1 | £ | 1 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4 | JPY | 466 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 6 | | 680 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 3.667.188 | $ | 30.325 | MSB | 0 | (179) | (179) | (0,03) |
| 02/2016 | SEK | 17.945 | | 2.154 | CBK | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | | | | | | $ 7.172 | $ (2.997) | $ 4.175 | 0,59 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Partially Hedged) Class und Class R GBP (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 224 | AUD | 308 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 308 | $ | 222 | NAB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 599 | CAD | 832 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 832 | $ | 625 | JPM | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 157 | | 153 | FBF | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 474 | | 68 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.691 | € | 3.359 | BOA | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 3.359 | $ | 3.579 | HUS | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 1.362 | £ | 905 | BPS | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 2.946 | $ | 4.372 | CBK | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.485 | £ | 2.969 | CBK | 0 | (110) | (110) | (0,02) |
| 01/2016 | | 4.475 | | 2.969 | DUB | 0 | (100) | (100) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 2.946 | $ | 4.372 | JPM | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.536 | £ | 1.019 | MSB | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 1.191 | $ | 1.763 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 154.388 | | 1.264 | GLM | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.276 | JPY | 154.388 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 205 | $ | 24 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 869 | | 100 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 308 | | 224 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 832 | | 599 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 3.359 | | 3.693 | BOA | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 4.372 | £ | 2.946 | CBK | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.372 | | 2.946 | JPM | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.763 | | 1.191 | MSB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 154.388 | $ | 1.277 | MSB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | | | | | | $ 143 | $ (487) | $ (344) | (0,05) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 747 | AUD | 1.027 | JPM | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1.027 | $ | 739 | NAB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.610 | CAD | 2.236 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 2.236 | $ | 1.678 | JPM | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 170 | | 170 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 433 | | 423 | FBF | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 610 | CHF | 603 | JPM | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 1.198 | $ | 171 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.325 | € | 9.396 | BOA | 0 | (118) | (118) | (0,02) |
| 01/2016 | € | 9.396 | $ | 10.013 | HUS | 0 | (194) | (194) | (0,03) |
| 01/2016 | £ | 1.008 | | 1.520 | MSB | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.492 | £ | 1.008 | SCX | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 430.651 | $ | 3.526 | GLM | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 3.559 | JPY | 430.651 | MSB | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 66.717 | $ | 7.633 | BOA | 96 | 0 | 96 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 12.423 | NOK | 107.779 | BPS | $ 0 | $ (246) | $ (246) | (0,03) |
| 01/2016 | NOK | 3.249 | $ | 367 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 106.689 | | 12.306 | JPM | 252 | 0 | 252 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 12.432 | NOK | 107.691 | JPM | 0 | (265) | (265) | (0,04) |
| 01/2016 | | 341 | | 2.906 | MSB | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.456 | | 82.236 | SCX | 0 | (165) | (165) | (0,02) |
| 01/2016 | NOK | 127.206 | $ | 14.670 | UAG | 298 | 0 | 298 | 0,04 |
| 01/2016 | NZD | 21 | | 14 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 2.343 | | 270 | CBK | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.027 | | 746 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 2.236 | | 1.610 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 603 | | 611 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 9.396 | | 10.332 | BOA | 117 | 0 | 117 | 0,02 |
| 02/2016 | £ | 1.008 | | 1.492 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 430.651 | | 3.561 | MSB | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 7.632 | NOK | 66.717 | BOA | 0 | (96) | (96) | (0,01) |
| 02/2016 | | 12.303 | | 106.689 | JPM | 0 | (253) | (253) | (0,04) |
| 02/2016 | | 14.666 | | 127.206 | UAG | 0 | (299) | (299) | (0,04) |
| | | | | | | $ 901 | $ (1.767) | $ (866) | (0,12) |

**(l) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BSN | 0,410 % | 03.11.2015 | 05.01.2016 | $ 14.479 | $ (14.489) | (2,04) |
| GRE | 0,950 % | 24.12.2015 | 04.01.2016 | 1.146 | (1.146) | (0,16) |
| GRE | 1,200 % | 28.12.2015 | 04.01.2016 | 13.466 | (13.467) | (1,90) |
| | | | | | $ (29.102) | (4,10) |

**(m) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäfte | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | (0,183 %) | 02.12.2015 | 06.01.2016 | € 9.389 | $ (10.199) | (1,44) |

**(n) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (114) | $ 0 | $ (114) |
| BOA | 1.995 | (2.920) | (925) |
| BPS | (941) | 1.000 | 59 |
| BRC | (1.542) | 1.320 | (222) |
| CBK | 1.809 | (1.670) | 139 |
| DUB | 2.093 | (3.890) | (1.797) |
| FBF | (18) | 0 | (18) |
| GLM | 723 | (700) | 23 |
| GST | (1.041) | 1.070 | 29 |
| HUS | 1.054 | (1.190) | (136) |
| JPM | 1.558 | (1.500) | 58 |
| MSB | 484 | (270) | 214 |
| MYC | (46) | 0 | (46) |
| NAB | (116) | 0 | (116) |
| SCX | 1.008 | (1.600) | (592) |
| SOG | (118) | 0 | (118) |
| UAG | 593 | (940) | (347) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(o) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 109,90 | 99,06 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,04 | (0,11) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,68) | (0,44) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,29 | (0,94) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (1,80) | 0,00 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,44 | 0,48 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 44.626.567 | $ 446.543 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 22.100 | 30.989 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 73.800 | 22.029 |
| Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 11.06.2020 | MXN | 184.000 | 12.506 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 24.700 | 7.353 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 01.02.2037 | € | 4.700 | 6.671 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 4.350 | 6.547 |
| Poland Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2023 | PLN | 20.500 | 6.421 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,500 % fällig am 01.11.2022 | € | 4.000 | 6.093 |
| France Government Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 4.872 | 5.964 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 17.000 | 5.654 |
| Spain Government Bond 4,650 % fällig am 30.07.2025 | € | 3.900 | 5.459 |
| Lloyds Bank PLC 5,125 % fällig am 07.03.2025 | | £2.700 | 5.193 |
| Bank of Ireland 10,000 % fällig am 30.07.2016 | € | 4.300 | 5.165 |
| Royal Bank of Scotland PLC 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | $3.900 | 4.425 |
| Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 51.634.000 | 4.394 |
| Bundesrepublik Deutschland 4,250 % fällig am 04.07.2039 | € | 1.900 | 3.782 |
| Bank of America Corp. 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | $3.200 | 3.556 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | | £ 2.142 | 3.482 |
| France Government Bond 3,250 % fällig am 25.05.2045 | € | 2.100 | 3.429 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 46.612.945 | $ 466.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 22.100 | 31.422 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 89.600 | 19.523 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,750 % fällig am 01.09.2044 | € | 11.800 | 18.597 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 9.875 | 15.796 |
| United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | £ 7.300 | 12.698 |
| Poland Government International Bond 4,000 % fällig am 25.10.2023 | PLN | 40.400 | 11.975 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 24.700 | 7.011 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 01.02.2037 | € | 4.700 | 6.289 |
| Mexico Government International Bond 10,000 % fällig am 05.12.2024 | MXN | 75.529 | 6.133 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,500 % fällig am 01.11.2022 | € | 4.000 | 5.832 |
| Spain Government Bond 4,650 % fällig am 30.07.2025 | | 3.900 | 5.262 |
| Mexico Government International Bond 7,750 % fällig am 29.05.2031 | MXN | 72.837 | 5.169 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked 1,875 % fällig am 22.11.2022 (b) | £ | 2.498 | 4.808 |
| Australia Government Bond 3,000 % fällig am 20.09.2025 | AUD | 3.800 | 4.414 |
| Canada Government Bond 1,250 % fällig am 01.03.2018 | CAD | 5.400 | 4.366 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 17.000 | 4.360 |
| Japan Government International Bond 1,600 % fällig am 20.03.2033 | JPY | 460.000 | 4.233 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,400 % fällig am 24.03.2017 | $ | 3.800 | 3.873 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 2.300 | 3.171 |

(a) Der Global Advantage Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 18.400 | $ | 4.172 | 0,88 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 36.200 | | 7.906 | 1,67 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | $ | 100 | | 71 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 100 | | 75 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 100 | | 79 | 0,02 |
| | | | | 12.303 | 2,60 |
| **KANADA** | | | | | |
| **Canada Government Bond (a)** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 | CAD | 10.111 | | 8.516 | 1,80 |
| 2,000 % fällig am 01.12.2041 | | 229 | | 219 | 0,04 |
| | | | | 8.735 | 1,84 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **Atrium V** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 20.07.2020 | $ | 737 | | 729 | 0,15 |
| **Fortress Credit Investments IV Ltd.** | | | | | |
| 1,565 % fällig am 17.07.2023 | | 1.945 | | 1.945 | 0,41 |
| **OHA Credit Partners VI Ltd.** | | | | | |
| 1,582 % fällig am 15.05.2023 | | 3.468 | | 3.451 | 0,73 |
| **Symphony CLO VIII LP** | | | | | |
| 1,419 % fällig am 09.01.2023 | | 7.533 | | 7.498 | 1,58 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 2.400 | | 2.382 | 0,50 |
| 1,641 % fällig am 15.10.2022 | | 1.700 | | 1.691 | 0,36 |
| | | | | 17.696 | 3,73 |
| **CHILE** | | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | | |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 700 | | 700 | 0,15 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2044 (a) | CLP | 1.794.036 | | 3.080 | 0,65 |
| **Bonos del Banco Central de Chile en UF** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.03.2022 (a) | | 5.253.963 | | 8.168 | 1,72 |
| | | | | 11.948 | 2,52 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **Colombian TES (a)** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 25.03.2033 | COP | 22.831.240 | | 6.137 | 1,29 |
| 3,500 % fällig am 10.03.2021 | | 11.050.320 | | 3.509 | 0,74 |
| 4,250 % fällig am 17.05.2017 | | 11.050.320 | | 3.628 | 0,77 |
| | | | | 13.274 | 2,80 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) | DKK | 67.322 | | 10.081 | 2,13 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **France Government Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (a)(b) | € | 7.272 | | 8.220 | 1,73 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (a)(b) | | 2.403 | | 2.678 | 0,57 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 (a) | | 104 | | 116 | 0,02 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (a)(b) | | 7.120 | | 8.138 | 1,72 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (a)(b) | | 3.012 | | 3.545 | 0,75 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (a)(b) | | 4.345 | | 5.265 | 1,11 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (a) | | 2.523 | | 3.673 | 0,77 |
| 3,500 % fällig am 25.04.2020 | | 1.600 | | 2.001 | 0,42 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 1.200 | | 1.167 | 0,25 |
| | | | | 34.803 | 7,34 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond (a)** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 | € | 386 | | 427 | 0,09 |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b)(c) | | 11.407 | | 12.710 | 2,68 |
| 1,750 % fällig am 15.04.2020 | | 329 | | 394 | 0,08 |
| | | | | 13.531 | 2,85 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GRIECHENLAND** | | | | | |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 1.200 | $ | 1.212 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 168.600 | | 1.290 | 0,27 |
| | | | | 2.502 | 0,53 |
| **GUERNSEY** | | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 600 | | 600 | 0,13 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | | |
| 2,753 % fällig am 30.03.2016 | | 6.800 | | 6.817 | 1,44 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **Harvest CLO V S.A.** | | | | | |
| 0,205 % fällig am 05.04.2024 | € | 1.211 | | 1.302 | 0,28 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 1.000 | | 101 | 0,02 |
| | | | | 1.403 | 0,30 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **ISRAEL** | | | | | |
| **Israel Government CPI-Linked Bond** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.05.2036 | ILS | 8.000 | | 3.675 | 0,77 |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | € | 4.400 | | 4.799 | 1,01 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | $ | 2.200 | | 2.201 | 0,46 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (a)** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 | € | 1.800 | | 2.028 | 0,43 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 1.829 | | 2.177 | 0,46 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (b) | | 17.861 | | 22.415 | 4,73 |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 1.414 | | 1.936 | 0,41 |
| **Marche M5 Srl** | | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | | 86 | | 94 | 0,02 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 255 | | 271 | 0,06 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 522 | | 576 | 0,12 |
| | | | | 36.497 | 7,70 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **Japan Government CPI-Linked Bond (a)** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 | JPY | 3.833.715 | | 33.711 | 7,11 |
| 1,100 % fällig am 10.09.2016 | | 30.957 | | 267 | 0,06 |
| 1,400 % fällig am 10.03.2018 | | 81.979 | | 739 | 0,16 |
| | | | | 34.717 | 7,33 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 4.300 | | 4.257 | 0,90 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 3,880 % fällig am 29.06.2017 (a) | MXN | 133.700 | | 7.737 | 1,63 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (a) | | 236.606 | | 13.906 | 2,94 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (a) | | 503.313 | | 32.099 | 6,77 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (a) | | 234.872 | | 14.913 | 3,15 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | | 11.279 | | 657 | 0,14 |
| | | | | 69.312 | 14,63 |
| Summe Mexiko | | | | 69.312 | 14,63 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **Vonovia Finance BV** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | | 4.400 | | 4.444 | 0,94 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **NEUSEELAND** | | | | | |
| **New Zealand Government Bond (a)** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 11.860 | $ | 8.225 | 1,74 |
| 2,500 % fällig am 20.09.2035 | | 1.700 | | 1.160 | 0,24 |
| | | | | 9.385 | 1,98 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | | |
| **South Africa Government CPI-Linked Bond (a)** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.01.2025 | ZAR | 7.916 | | 505 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 07.12.2023 | | 27.814 | | 2.253 | 0,47 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.01.2020 | | 138.400 | | 8.374 | 1,77 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | | 180.400 | | 9.885 | 2,08 |
| | | | | 21.017 | 4,43 |
| **SÜDKOREA** | | | | | |
| **Inflation-Linked Korea Treasury Bond** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 10.06.2023 (a) | | 13.562.856 | | 11.281 | 2,38 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | € | 400 | | 460 | 0,10 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 2.800 | | 2.981 | 0,63 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | | |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | | 1.000 | | 1.184 | 0,25 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 1.600 | | 1.630 | 0,34 |
| **Spain Government Bond** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 200 | | 225 | 0,05 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 (a) | | 1.500 | | 1.602 | 0,34 |
| | | | | 8.082 | 1,71 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **Sweden Inflation-Linked Bond (a)** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 | SEK | 4.400 | | 530 | 0,11 |
| 0,250 % fällig am 01.06.2022 | | 10.600 | | 1.351 | 0,28 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 1.600 | | 217 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2020 | | 14.200 | | 2.706 | 0,57 |
| | | | | 4.804 | 1,01 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.800 | | 2.056 | 0,43 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.100 | | 2.205 | 0,47 |
| | | | | 4.261 | 0,90 |
| **THAILAND** | | | | | |
| **Thailand Government Bond (a)** | | | | | |
| 1,200 % fällig am 14.07.2021 | THB | 244.914 | | 6.464 | 1,37 |
| 1,250 % fällig am 12.03.2028 | | 141.367 | | 3.469 | 0,73 |
| | | | | 9.933 | 2,10 |
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **Turkey Government International Bond (a)** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.04.2025 | TRY | 11.022 | | 3.563 | 0,75 |
| 2,400 % fällig am 08.05.2024 | | 18.323 | | 6.123 | 1,29 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2020 | | 72.917 | | 26.393 | 5,57 |
| | | | | 36.079 | 7,61 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 2,010 % fällig am 21.12.2020 | | 2.500 | | 141 | 0,03 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 1.200 | | 1.417 | 0,30 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 760 | | 1.489 | 0,31 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 600 | | 939 | 0,20 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | | $ | |
| | £ | 1.600 | 2.401 | 0,51 |
| | | | 6.387 | 1,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | | 26.280 | 41.097 | 8,67 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (b) | | 1.638 | 2.991 | 0,63 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 | | 1.278 | 2.365 | 0,50 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 1.091 | 2.575 | 0,54 |
| 0,750 % fällig am 22.03.2034 | | 447 | 829 | 0,18 |
| 1,125 % fällig am 22.11.2037 (b) | | 1.155 | 2.412 | 0,51 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 | | 1.498 | 2.706 | 0,57 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 | | 1.893 | 3.308 | 0,70 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 1.070 | 5.601 | 1,18 |
| | | | 63.884 | 13,48 |
| Summe Großbritannien | | | 70.271 | 14,83 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 1.600 | 1.600 | 0,34 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 31.000 | 1.925 | 0,41 |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | $ | 3.200 | 3.213 | 0,68 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2017 | | 400 | 428 | 0,09 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 700 | 695 | 0,15 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 2.400 | 2.408 | 0,51 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2019 | | 1.093 | 1.251 | 0,26 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 6,300 % fällig am 23.04.2019 | | 900 | 1.010 | 0,21 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.11.2016 | | 100 | 100 | 0,02 |
| **Vornado Realty LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.06.2019 | | 2.000 | 1.971 | 0,42 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 01.04.2017 | | 5.900 | 5.873 | 1,24 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 600 | 591 | 0,12 |
| | | | 21.065 | 4,45 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | $ 200 | $ 180 | 0,04 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,475 % fällig am 26.07.2035 | 500 | 489 | 0,10 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 1.142 | 1.092 | 0,23 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,522 % fällig am 25.03.2035 | 2.100 | 1.978 | 0,42 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 1,397 % fällig am 25.05.2035 | 1.179 | 1.123 | 0,24 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,222 % fällig am 19.11.2044 | 721 | 626 | 0,13 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 0,912 % fällig am 25.07.2035 | 300 | 267 | 0,06 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.06.2036 | 874 | 750 | 0,16 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | 1.217 | 1.181 | 0,25 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | 2.203 | 2.154 | 0,45 |
| 0,592 % fällig am 25.04.2036 | 2.201 | 2.073 | 0,44 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | |
| 0,732 % fällig am 25.12.2035 | 1.484 | 1.335 | 0,28 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,217 % fällig am 25.06.2036 | 267 | 261 | 0,05 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | |
| 0,421 % fällig am 26.12.2036 | 3.136 | 2.814 | 0,59 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,842 % fällig am 25.12.2035 | 600 | 516 | 0,11 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,902 % fällig am 25.09.2035 | 1.200 | 1.086 | 0,23 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,422 % fällig am 25.08.2037 | 3.171 | 2.941 | 0,62 |
| | | 20.866 | 4,40 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2016 - 15.07.2024 (b)(c)(e) | $ 91.032 | $ 89.483 | 18,88 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 - 15.07.2025 (b) | 15.254 | 14.882 | 3,14 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 - 15.02.2043 (b)(c)(e) | 5.532 | 5.320 | 1,12 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 - 15.02.2045 (b)(c) | 16.010 | 14.076 | 2,97 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b)(c)(e) | 15.032 | 15.333 | 3,24 |
| 1,625 % fällig am 15.01.2018 | 227 | 234 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | 6.624 | 7.248 | 1,53 |
| 1,875 % fällig am 15.07.2019 (c) | 446 | 473 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b)(c) | 21.857 | 24.312 | 5,13 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b) | 2.861 | 3.376 | 0,71 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 - 15.01.2027 (b)(c)(e) | 8.987 | 10.324 | 2,18 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 (b)(e) | 4.729 | 5.042 | 1,07 |
| 2,625 % fällig am 15.07.2017 | 230 | 240 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | 221 | 289 | 0,06 |
| | | 190.632 | 40,23 |
| Summe USA | | 232.563 | 49,08 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (d)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 12.698 | 127 | 0,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 694.398** | **146,54** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 25 | $ 38 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 69 | 168 | 0,04 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 468 | (121) | (0,03) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 82 | 3 | 0,00 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 84 | 24 | 0,00 |
| | | | | $ 112 | 0,02 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 551 | $ 65 | $ 41 | 0,01 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,875 | 11.03.2016 | 148 | 22 | 34 | 0,01 |
| Call - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 137,000 | 19.02.2016 | 82 | 1 | 1 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 112,500 | 19.02.2016 | 468 | 4 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 92 | $ 80 | 0,02 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 148 | $ (12) | $ (1) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | 98,000 | 21.12.2016 | 551 | (13) | (8) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 148 | (6) | (10) | 0,00 |
| | | | | $ (31) | $ (19) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 173** | **0,04** |

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

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 1.300 | $ 2 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 131.200 | $ 58 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,225 % | 16.09.2025 | 2.500 | (22) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 4.300 | (41) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 28.500 | 48 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 18.700 | 63 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,670 % | 13.07.2045 | 4.440 | (62) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 5.150 | 110 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,570 % | 10.02.2046 | 1.000 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 1.200 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | € 3.700 | 40 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 32.400 | 64 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,088 % | 04.12.2024 | 11.600 | (235) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 17.370 | (165) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 4.450 | (149) | (0,03) |
| | | | | | $ (268) | (0,06) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (266)** | **(0,06)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | $ 9.600 | $ 70 | $ 43 | 0,01 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 46.200 | 29 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 44.700 | 36 | 3 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 45.000 | 42 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 195.600 | 206 | 13 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 23.06.2016 | 43.900 | 81 | 99 | 0,02 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 24.06.2016 | 43.400 | 78 | 98 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,683 % | 11.12.2017 | 4.000 | 560 | 401 | 0,09 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | 118.600 | 101 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 1.203 | $ 661 | 0,14 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 900 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 900 | (2) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 900 | (2) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (6) | $ (2) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 2.100 | $ (89) | $ (103) | (0,02) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,700 | 14.01.2016 | 4.800 | (80) | (5) | 0,00 |
| | | | | | $ (169) | $ (108) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 9.600 | $ (76) | $ (61) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 19.01.2016 | 9.100 | (37) | (3) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 % | 19.01.2016 | 9.100 | (33) | (3) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 29.400 | (94) | (44) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 19.600 | (74) | (29) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 11.12.2017 | 16.800 | (560) | (287) | (0,06) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 5.200 | (20) | (8) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | RYL | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 10.400 | (37) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (931) | $ (441) | (0,09) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| Cap - OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial)-(1+3,000 %)*20, 0,000 %] | 22.06.2035 | € 2.700 | $ (123) | $ (69) | (0,02) |
| Cap - OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 %-(Referenzindex Final/Referenzindex Initial-1)-3,000 %] | 01.06.2016 | $ 2.200 | (2) | 0 | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 243,273 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1)-4,00 % oder $0] | 22.04.2024 | 7.500 | (55) | (11) | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 244,172 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1)-4,00 % oder $0] | 16.05.2024 | 700 | (5) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (185) | $ (81) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | $ 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | $ 10.900 | $ (123) | $ (144) | (0,03) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | $ 300 | $ (1) | $ (23) | $ 22 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 1.900 | (5) | (121) | 116 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 700 | (2) | (52) | 50 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 500 | (1) | (39) | 38 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 6.400 | 72 | (130) | 202 | 0,02 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 50 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 1.050 | 12 | (20) | 32 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 900 | 11 | (9) | 20 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 5.200 | 64 | (46) | 110 | 0,01 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 1.300 | 16 | (12) | 28 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 820 | (1) | (6) | 5 | 0,00 |
| | | | | | $ 165 | $ (459) | $ 624 | 0,03 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,030 % | 02.01.2018 | BOA | BRL 72.500 | $ (917) | $ (102) | $ (815) | (0,19) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | JPM | 99.700 | (989) | (173) | (816) | (0,21) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,560 % | 04.01.2021 | BPS | 4.800 | (56) | (1) | (55) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | BPS | 7.300 | (35) | 0 | (35) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,710 % | 04.01.2021 | HUS | 10.100 | (43) | 0 | (43) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,525 % | 15.10.2017 | UAG | € 2.400 | (4) | 2 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,540 % | 15.10.2017 | BRC | 1.100 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,550 % | 15.10.2017 | BPS | 800 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,570 % | 15.10.2017 | DUB | 400 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | DUB | 1.100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | JPM | 1.700 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,420 % | 15.08.2018 | BRC | 3.200 | 17 | 4 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,470 % | 15.08.2018 | FBF | 7.800 | 28 | (2) | 30 | 0,01 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,655 % | 15.08.2018 | CBK | 800 | (2) | (1) | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,605 % | 15.09.2018 | DUB | 1.600 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,610 % | 15.09.2018 | UAG | 1.300 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,625 % | 15.09.2018 | BRC | 3.300 | (5) | 1 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,640 % | 15.09.2018 | CBK | 900 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.09.2018 | GLM | 1.500 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | CBK | 900 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 2.900 | (4) | 1 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | GLM | 1.500 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.10.2018 | SOG | 1.100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 3.300 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,190 % | 15.04.2030 | CBK | 3.200 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,320 % | 15.05.2030 | UAG | 2.500 | 91 | 0 | 91 | 0,02 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | BRC | 4.200 | 187 | (1) | 188 | 0,04 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | DUB | 2.700 | 120 | 0 | 120 | 0,02 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | CBK | 1.700 | 43 | (6) | 49 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | DUB | 1.600 | 41 | 3 | 38 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,275 % | 15.09.2030 | CBK | 1.000 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,275 % | 15.09.2030 | JPM | 1.200 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,335 % | 15.04.2035 | FBF | 1.000 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,358 % | 15.04.2035 | GLM | 1.000 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,550 % | 15.11.2044 | FBF | 1.500 | 182 | (1) | 183 | 0,04 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,800 % | 17.01.2016 | DUB | $ 9.600 | (174) | 0 | (174) | (0,04) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 15.04.2016 | GLM | 1.300 | (32) | (3) | (29) | (0,01) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,825 % | 29.11.2016 | BPS | 2.600 | (72) | (1) | (71) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,825 % | 29.11.2016 | DUB | 5.200 | (144) | (3) | (141) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,845 % | 29.11.2016 | DUB | 1.900 | (54) | 0 | (54) | (0,01) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,935 % | 20.01.2017 | DUB | 2.200 | (63) | 0 | (63) | (0,01) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,415 % | 12.02.2017 | GLM | 1.600 | (90) | 0 | (90) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,250 % | 15.07.2017 | RYL | 4.600 | (271) | 4 | (275) | (0,06) |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,215 % | 17.01.2019 | UAG | 3.200 | (157) | 0 | (157) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,725 % | 04.03.2019 | DUB | 125 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,500 % | 15.07.2022 | DUB | 500 | (54) | 4 | (58) | (0,01) |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,060 % | 12.05.2025 | GLM | 11.500 | 236 | 0 | 236 | 0,05 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 26.08.2025 | BOA | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ (2.152) | $ (275) | $ (1.877) | (0,46) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 23 | $ | 17 | RBC | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.600 | BRL | 18.213 | BOA | 24 | (21) | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 18.213 | $ | 4.640 | BOA | 36 | 0 | 36 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 932 | BRL | 3.519 | BPS | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 3.519 | $ | 907 | BPS | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.565 | | 2.266 | CBK | 354 | 0 | 354 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 1.937 | BRL | 7.565 | CBK | 0 | (25) | (25) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Advantage Real Return Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 79.259 | $ | 20.240 | DUB | $ 206 | $ 0 | $ 206 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 20.985 | BRL | 79.259 | DUB | 0 | (951) | (951) | (0,20) |
| 01/2016 | BRL | 131 | $ | 35 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 34 | BRL | 131 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 805 | $ | 205 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 206 | BRL | 805 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.614 | $ | 695 | JPM | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 669 | BRL | 2.614 | JPM | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 291 | $ | 74 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 74 | BRL | 291 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 30 | $ | 22 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 8.133 | | 1.256 | JPM | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| 01/2016 | € | 7 | | 8 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 170 | € | 156 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 138 | $ | 151 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 33.687 | | 50.783 | DUB | 1.132 | 0 | 1.132 | 0,24 |
| 01/2016 | $ | 49.991 | £ | 33.687 | JPM | 0 | (339) | (339) | (0,07) |
| 01/2016 | £ | 34 | $ | 50 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5 | £ | 4 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.652 | ILS | 6.445 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.229 | INR | 81.219 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 1.676 | $ | 14 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 24.371 | | 21 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.604.768 | | 3.131 | JPM | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 9.463 | KRW | 11.130.538 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 16.848 | $ | 10.985 | BOA | 0 | (549) | (549) | (0,12) |
| 01/2016 | TRY | 6.302 | | 2.137 | CBK | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.299 | TRY | 27.176 | CBK | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 21.973 | $ | 7.388 | JPM | 0 | (107) | (107) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 2.089 | ZAR | 32.506 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 7.643 | $ | 5.369 | CBK | 0 | (181) | (181) | (0,04) |
| 02/2016 | | 619 | | 447 | DUB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 17.721 | AUD | 24.685 | HUS | 205 | 0 | 205 | 0,04 |
| 02/2016 | BRL | 11.990 | $ | 2.976 | BOA | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 02/2016 | | 37.354 | | 9.292 | BRC | 0 | (54) | (54) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 16.280 | BRL | 64.423 | DUB | 0 | (162) | (162) | (0,03) |
| 02/2016 | BRL | 80.669 | $ | 20.080 | FBF | 0 | (104) | (104) | (0,02) |
| 02/2016 | | 27.239 | | 6.808 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 73.597 | BRL | 295.935 | JPM | 445 | 0 | 445 | 0,09 |
| 02/2016 | CAD | 794 | $ | 596 | DUB | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| 02/2016 | | 441 | | 325 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 676 | CAD | 897 | JPM | 0 | (30) | (30) | (0,01) |
| 02/2016 | | 5.901 | | 7.858 | MSB | 0 | (244) | (244) | (0,05) |
| 02/2016 | | 1.658 | COP | 5.313.890 | BRC | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.783 | | 8.795.672 | CBK | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 18.116.307 | $ | 6.171 | HUS | 488 | 0 | 488 | 0,10 |
| 02/2016 | $ | 2.467 | COP | 7.849.750 | SOG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 77.805 | $ | 11.243 | HUS | 0 | (95) | (95) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 1.114 | DKK | 7.630 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 160 | $ | 173 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.188 | € | 13.197 | CBK | 179 | (18) | 161 | 0,03 |
| 02/2016 | € | 1.980 | $ | 2.164 | CBK | 16 | (5) | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.992 | € | 1.828 | GLM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 681 | $ | 734 | JPM | 2 | (9) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 18.864 | € | 17.270 | JPM | 0 | (86) | (86) | (0,02) |
| 02/2016 | | 12.320 | | 11.603 | SCX | 296 | 0 | 296 | 0,06 |
| 02/2016 | € | 169 | $ | 186 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 644 | | 977 | BOA | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| 02/2016 | | 3.544 | | 5.329 | CBK | 105 | 0 | 105 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 49.410 | £ | 32.712 | HUS | 0 | (1.192) | (1.192) | (0,25) |
| 02/2016 | | 2.038 | | 1.353 | JPM | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 33.687 | $ | 49.993 | JPM | 337 | 0 | 337 | 0,07 |
| 02/2016 | $ | 9.361 | ILS | 36.307 | DUB | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.143 | | 4.416 | HUS | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 14.331 | $ | 3.675 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.871 | | 1.764 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.349 | INR | 294.044 | CBK | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| 02/2016 | | 1.221 | JPY | 147.600 | BOA | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.304 | | 407.000 | JPM | 82 | 0 | 82 | 0,02 |
| 02/2016 | JPY | 567.621 | $ | 4.617 | JPM | 0 | (105) | (105) | (0,02) |
| 02/2016 | | 13.700 | | 112 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 483 | NZD | 721 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | NZD | 453 | $ | 297 | HUS | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.179 | NZD | 4.875 | JPM | 150 | 0 | 150 | 0,03 |
| 02/2016 | NZD | 16.848 | $ | 11.521 | JPM | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 2.470 | | 285 | DUB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 5.013 | | 3.561 | SCX | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| 02/2016 | THB | 370.598 | | 10.323 | BOA | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 292 | THB | 10.496 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 117.954 | $ | 3.634 | BPS | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 603 | MXN | 10.392 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 551.867 | $ | 31.650 | CBK | 0 | (143) | (143) | (0,03) |
| 03/2016 | | 73.350 | | 4.278 | GLM | 52 | 0 | 52 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 03/2016 | $ | 7.260 | MXN | 126.229 | HUS | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| 03/2016 | | 254 | | 4.433 | NGF | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 46.389 | $ | 14.420 | JPM | 3.052 | 0 | 3.052 | 0,64 |
| 04/2016 | $ | 1.253 | CLP | 901.847 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 04/2016 | | 1.511 | | 1.081.558 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 76.853 | $ | 5.195 | BOA | 354 | 0 | 354 | 0,07 |
| 05/2016 | | 5.037 | | 339 | SCX | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 9.161 | | 1.390 | SCX | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| 09/2016 | $ | 374 | CNH | 2.424 | UAG | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 6.100 | $ | 1.548 | BOA | 141 | 0 | 141 | 0,03 |
| 10/2016 | | 2.400 | | 578 | BPS | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| 10/2016 | | 1.800 | | 436 | CBK | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 10/2016 | | 8.100 | | 2.020 | JPM | 152 | 0 | 152 | 0,03 |
| 10/2016 | CNH | 14.267 | | 2.205 | SCX | 96 | 0 | 96 | 0,02 |
| 01/2017 | BRL | 4.900 | | 1.128 | BPS | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| 01/2017 | | 6.000 | | 1.387 | DUB | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 01/2017 | | 13.000 | | 3.041 | GLM | 122 | 0 | 122 | 0,03 |
| 01/2017 | | 12.300 | | 2.893 | JPM | 131 | 0 | 131 | 0,03 |
| | | | | | | $ 8.807 | $ (4.692) | $ 4.115 | 0,87 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 2.013** | **0,42** |
| **Summe Anlagen** | **$ 696.318** | **146,94** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 380 | $ 561 | 0,12 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | 12 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 70 | 48 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 36 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 328 | 328 | 0,07 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 4 | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 72 | 10 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 142 | 9 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 3 | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 102 | 102 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 86 | 86 | 0,02 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 659 | 43 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 99 | 99 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 182 | 198 | 0,04 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 120 | 177 | 0,04 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 15 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 1.689** | **0,36** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (224.143)** | **(47,30)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 473.864** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 268.353 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 22.148 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(d) **Der Global Advantage Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.549 und Barmittel von USD 1.007 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.040 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(g) Barmittel in Höhe von USD 770 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(h) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 228 | $ 686.433 | $ 7.737 | $ 694.398 |
| Finanzderivate[3] | 173 | 1.747 | 0 | 1.920 |
| **Summen** | **$ 401** | **$ 688.180** | **$ 7.737** | **$ 696.318** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.614 | $ 891.762 | $ 2.789 | $ 899.165 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.998 | 0 | 1.998 |
| Finanzderivate[3] | (362) | (5.443) | 0 | (5.805) |
| Leerverkäufe | 0 | (11.438) | 0 | (11.438) |
| **Summen** | **$ 4.252** | **$ 876.879** | **$ 2.789** | **$ 883.920** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(i) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 239 | AUD | 329 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 332 | $ | 239 | NAB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | AUD | 3 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 306 | CAD | 426 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 430 | $ | 322 | JPM | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | CAD | 4 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 8 | $ | 7 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 173 | | 173 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.587 | | 2.617 | CBK | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.681 | CHF | 2.737 | DUB | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| 01/2016 | | 57 | | 59 | FBF | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 557 | | 569 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 855 | $ | 866 | JPM | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 61 | | 59 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.592 | | 2.624 | UAG | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.695 | CHF | 2.737 | UAG | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 01/2016 | | 1.859 | € | 1.692 | BOA | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | | 61 | | 56 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.712 | $ | 1.824 | HUS | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 19 | € | 18 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5 | £ | 3 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 460 | | 310 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 313 | $ | 472 | MSB | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9 | JPY | 1.081 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 92.963 | $ | 761 | GLM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 759 | JPY | 91.882 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 37 | $ | 25 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 891 | | 102 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 107 | SEK | 891 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 329 | $ | 239 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 426 | | 307 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.620 | CHF | 2.587 | CBK | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| 02/2016 | | 867 | | 855 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.627 | | 2.592 | UAG | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| 02/2016 | € | 1.692 | $ | 1.860 | BOA | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| 02/2016 | £ | 310 | | 460 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 91.882 | | 760 | MSB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 891 | | 107 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 238 | $ (164) | $ 74 | 0,02 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Partially Hedged) Class, Institutional EUR (Partially Hedged) Class, Class E EUR (Partially Hedged) und Class G EUR (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 43 | AUD | 59 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 46 | | 64 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.159 | | 13.973 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 14.150 | $ | 10.180 | NAB | 0 | (115) | (115) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 13 | AUD | 18 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 39 | | 54 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 17 | CAD | 23 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.903 | | 16.528 | BOA | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 49 | | 67 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 16.658 | $ | 12.501 | JPM | 509 | 0 | 509 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 6 | CAD | 8 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 24 | | 32 | NAB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 17 | | 24 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 55.156 | € | 51.732 | BOA | 1.040 | 0 | 1.040 | 0,22 |
| 01/2016 | € | 145 | $ | 153 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 245 | | 268 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.461 | | 3.760 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.077 | | 1.172 | CBK | 5 | (3) | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.116 | € | 3.868 | CBK | 86 | 0 | 86 | 0,02 |
| 01/2016 | € | 88 | $ | 94 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 108.325 | € | 101.649 | HUS | 2.096 | 0 | 2.096 | 0,44 |
| 01/2016 | € | 57.553 | $ | 63.248 | HUS | 728 | 0 | 728 | 0,15 |
| 01/2016 | | 119 | | 126 | NAB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 227 | | 248 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.604 | | 1.757 | SCX | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | | 96.416 | | 105.302 | UAG | 576 | (10) | 566 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 54 | £ | 36 | AZD | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 56 | | 37 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50 | | 33 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 99 | | 66 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11 | | 7 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 17.622 | | 11.903 | MSB | 0 | (78) | (78) | (0,02) |
| 01/2016 | £ | 12.091 | $ | 18.229 | MSB | 408 | 0 | 408 | 0,09 |
| 01/2016 | $ | 30 | £ | 20 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14 | | 9 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 87 | $ | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 186 | JPY | 22.772 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 86 | | 10.635 | BRC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 25 | | 3.063 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4 | | 512 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 3.769.594 | $ | 30.860 | GLM | 0 | (476) | (476) | (0,10) |
| 01/2016 | $ | 30.410 | JPY | 3.679.552 | MSB | 178 | 0 | 178 | 0,04 |
| 01/2016 | | 48 | | 5.825 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 436 | | 53.071 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 1.199 | $ | 798 | BOA | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| 01/2016 | SEK | 34.089 | | 3.909 | BOA | 0 | (135) | (135) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 4.089 | SEK | 34.089 | CBK | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| 02/2016 | | 9 | AUD | 13 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 13.973 | $ | 10.145 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 12 | CAD | 17 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 16.419 | $ | 11.823 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 162 | | 177 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 63.293 | € | 57.553 | HUS | 0 | (728) | (728) | (0,15) |
| 02/2016 | | 104.849 | | 95.922 | UAG | 0 | (576) | (576) | (0,12) |
| 02/2016 | £ | 11.903 | $ | 17.623 | MSB | 78 | 0 | 78 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 19 | £ | 13 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 35 | JPY | 4.163 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 90 | | 10.923 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 3.679.552 | $ | 30.427 | MSB | 0 | (180) | (180) | (0,04) |
| 02/2016 | SEK | 34.089 | | 4.092 | CBK | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| | | | | | | $ 5.789 | $ (2.395) | $ 3.394 | 0,72 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Partially Hedged) Class, Investor GBP (Partially Hedged) Class und Class R GBP (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 17 | AUD | 23 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 10 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 796 | | 1.095 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1.142 | $ | 822 | NAB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4 | AUD | 5 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 9 | | 13 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8 | CAD | 11 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 904 | | 1.255 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8 | | 11 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CAD | 1.289 | $ | 967 | JPM | $ 39 | $ 0 | $ 39 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1 | CAD | 2 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 9 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4 | | 6 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.612 | € | 5.108 | BOA | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| 01/2016 | | 19 | | 17 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 143 | $ | 152 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 146 | € | 134 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 7 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 5.213 | $ | 5.555 | HUS | 0 | (108) | (108) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 5 | € | 5 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 33 | | 30 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 91 | | 85 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 81 | $ | 121 | AZD | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 223 | | 335 | BOA | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | | 163 | | 246 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.211 | | 7.733 | CBK | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 575 | £ | 380 | CBK | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.427 | | 5.590 | DUB | 0 | (188) | (188) | (0,04) |
| 01/2016 | £ | 41 | $ | 62 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 36 | £ | 24 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 5.209 | $ | 7.731 | JPM | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 8.399 | £ | 5.571 | MSB | 0 | (188) | (188) | (0,04) |
| 01/2016 | £ | 624 | $ | 923 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 62 | | 92 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14 | | 21 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 51 | JPY | 6.278 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 35 | | 4.338 | BRC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10 | | 1.247 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4 | | 538 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 285.390 | $ | 2.336 | GLM | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 2.236 | JPY | 270.526 | MSB | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13 | | 1.598 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 20 | | 2.463 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 162 | $ | 108 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 2.882 | | 330 | BOA | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 346 | SEK | 2.882 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1 | AUD | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.095 | $ | 795 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 1.230 | | 885 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | CAD | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 5.094 | $ | 5.601 | BOA | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 4 | € | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.719 | £ | 5.201 | CBK | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| 02/2016 | | 7.731 | | 5.209 | JPM | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| 02/2016 | | 923 | | 624 | MSB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 8 | $ | 11 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2 | JPY | 199 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1 | | 156 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 270.526 | $ | 2.237 | MSB | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 2.882 | | 346 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | | $ 251 | $ (752) | $ (501) | (0,11) |

**(j) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,450 % | 07.10.2015 | 07.04.2016 | $ 31.933 | $ (31.967) | (6,75) |
| BOS | 0,650 % | 23.11.2015 | 04.01.2016 | 1.077 | (1.077) | (0,23) |
| BOS | 0,700 % | 27.11.2015 | 08.01.2016 | 17.804 | (17.816) | (3,76) |
| BOS | 0,750 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | 6.696 | (6.700) | (1,41) |
| BSN | 0,340 % | 13.10.2015 | 13.01.2016 | 10.513 | (10.521) | (2,22) |
| BSN | 0,450 % | 05.11.2015 | 06.01.2016 | 9.175 | (9.182) | (1,94) |
| GRE | 0,580 % | 16.11.2015 | 15.01.2016 | 54.651 | (54.692) | (11,54) |
| GRE | 0,580 % | 19.11.2015 | 19.01.2016 | 25.942 | (25.960) | (5,48) |
| GRE | 0,950 % | 02.12.2015 | 04.01.2016 | 5.015 | (5.019) | (1,06) |
| GRE | 1,000 % | 31.12.2015 | 07.01.2016 | 13.503 | (13.503) | (2,85) |
| MYI | (0,150 %) | 05.10.2015 | 14.01.2016 | € 219 | (238) | (0,05) |
| MYI | (0,050 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | 19.190 | (20.844) | (4,40) |
| SCX | 0,720 % | 15.10.2015 | 21.01.2016 | £ 28.503 | (42.075) | (8,88) |
| SCX | 0,720 % | 21.10.2015 | 21.01.2016 | 1.940 | (2.864) | (0,60) |
| | | | | | $ (242.458) | (51,17) |

**(k) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 0,760 % | 31.12.2015 | 04.01.2016 | $ 806 | $ (806) | (0,17) |
| BPG | 1,014 % | 31.12.2015 | 04.01.2016 | 753 | (753) | (0,16) |
| MEI | (0,020 %) | 31.12.2015 | 12.01.2016 | € 17.272 | (18.765) | (3,96) |
| MSC | 0,373 % | 09.10.2015 | 07.01.2016 | $ 3.070 | (3.072) | (0,65) |
| MYI | (0,183 %) | 02.12.2015 | 06.01.2016 | € 11.648 | (12.653) | (2,67) |
| MYI | (0,152 %) | 04.11.2015 | 12.01.2016 | 7.611 | (8.266) | (1,74) |
| TDM | 0,557 % | 16.11.2015 | 12.02.2016 | $ 5.073 | (5.082) | (1,07) |
| | | | | | $ (49.397) | (10,42) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 7 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(l) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 2 | $ 0 | $ 2 |
| BOA | (5) | (210) | (215) |
| BPS | (69) | 0 | (69) |
| BRC | 162 | (210) | (48) |
| CBK | 504 | (720) | (216) |
| DUB | (152) | (250) | (402) |
| FBF | (12) | 0 | (12) |
| GLM | (346) | 0 | (346) |
| GST | 59 | 0 | 59 |
| HUS | 1.306 | (1.830) | (524) |
| JPM | 3.172 | (2.670) | 502 |
| MSB | (17) | 0 | (17) |
| MYC | 352 | (280) | 72 |
| NAB | (131) | 0 | (131) |
| NGF | (4) | 0 | (4) |
| RBC | 2 | 0 | 2 |
| RYL | (277) | 340 | 63 |
| SCX | 492 | (610) | (118) |
| SOG | (7) | 0 | (7) |
| UAG | (51) | 0 | (51) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(m) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 146,54 | 136,68 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,04 | (0,05) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,06) | (0,91) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,42 | 0,08 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (1,74) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,30 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Advantage Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 44.023.154 | $ 440.512 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | $ | 74.963 | 75.196 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 263.600 | 68.616 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 35.469 | 59.501 |
| France Government Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 44.705 | 53.804 |
| Mexico Government International Bond 4,500 % fällig am 04.12.2025 | MXN | 765.535 | 52.666 |
| US Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022 | $ | 52.500 | 52.158 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 | € | 35.322 | 45.834 |
| Japan Government CPI-Linked Bond 0,100 % fällig am 10.09.2024 (b) | JPY | 4.913.289 | 43.891 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 32.292 | 40.407 |
| France Government Bond 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 34.644 | 40.277 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | $ | 40.141 | 38.986 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | | 35.618 | 37.136 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 37.169 | 36.411 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 155.110 | 36.311 |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | $ | 33.540 | 30.930 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 29.858 | 29.178 |
| Turkey Government International Bond 4,000 % fällig am 01.04.2020 | TRY | 70.472 | 27.727 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,100 % fällig am 15.04.2026 (b) | € | 21.300 | 25.469 |
| US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | $ | 25.300 | 25.255 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 21.055 | 24.895 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 20.823 | 24.536 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 24.000 | 23.952 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 23.140 | 23.064 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | 21.783 | 21.443 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 20.660 | 20.513 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 20.340 | 20.187 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2017 (b) | | 19.738 | 20.034 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | € | 16.991 | 20.033 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 44.461.427 | $ 444.900 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | $ | 73.788 | 74.626 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 54.461 | 68.635 |
| France Government Bond 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 56.148 | 64.233 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 227.400 | 59.902 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 | € | 42.165 | 55.246 |
| US Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022 | $ | 52.500 | 51.556 |
| France Government Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 43.791 | 51.196 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | $ | 43.223 | 45.425 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 37.373 | 36.474 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | € | 30.498 | 35.393 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | $ | 34.998 | 34.878 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | | 36.004 | 34.596 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 132.450 | 31.072 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 31.651 | 30.644 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 18.192 | 30.271 |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | $ | 33.540 | 29.636 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 155.110 | 29.009 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 24.154 | 28.415 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,100 % fällig am 15.04.2026 (b) | € | 21.253 | 26.294 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 21.753 | 25.276 |
| US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | | 25.300 | 25.052 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,100 % fällig am 15.04.2023 (b) | € | 20.680 | 24.845 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | $ | 24.000 | 24.052 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 23.140 | 23.369 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B 6,000 % fällig am 15.05.2019 | BRL | 32.500 | 22.694 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2044 | $ | 20.660 | 20.556 |

(a) Der Global Advantage Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund



| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.03.2017 | $ | 500 | $ 505 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 03.05.2022 | € | 700 | 867 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 04.09.2026 | £ | 11.700 | 17.636 | 0,22 |
| **Goodman Funding Pty Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.11.2020 | $ | 1.800 | 2.046 | 0,03 |
| **Harvey Trust** | | | | |
| 2,425 % fällig am 11.07.2038 | AUD | 138 | 99 | 0,00 |
| **Interstar Millennium Trust** | | | | |
| 2,490 % fällig am 27.03.2038 | | 38 | 26 | 0,00 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.06.2017 | $ | 3.800 | 3.833 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 22.02.2019 | | 5.000 | 4.992 | 0,06 |
| **New South Wales Treasury Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.11.2025 (a) | AUD | 300 | 317 | 0,00 |
| **Superannuation Members Home Loan Securitisation Fund** | | | | |
| 3,560 % fällig am 09.09.2041 | | 43 | 31 | 0,00 |
| **TORRENS Trust** | | | | |
| 2,485 % fällig am 19.10.2038 | | 789 | 574 | 0,01 |
| **Treasury Corporation of Victoria** | | | | |
| 6,000 % fällig am 17.10.2022 | | 800 | 698 | 0,01 |
| **Westpac Banking Corp.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.12.2017 | $ | 500 | 496 | 0,01 |
| 1,850 % fällig am 26.11.2018 | | 7.600 | 7.586 | 0,10 |
| | | | 39.706 | 0,51 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 30.09.2021 | € | 500 | 570 | 0,01 |
| **Belgium Government Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.03.2035 | | 192 | 319 | 0,00 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 3.600 | 3.933 | 0,05 |
| **Solvay S.A.** | | | | |
| 0,706 % fällig am 01.12.2017 | € | 10.700 | 11.673 | 0,15 |
| | | | 16.495 | 0,21 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | $ | 5.560 | 5.635 | 0,07 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 8.700 | 8.504 | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 9.000 | 8.888 | 0,11 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 10.000 | 9.275 | 0,12 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 10.100 | 7.196 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 2.600 | 2.438 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 3.300 | 2.483 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 2.250 | 2.008 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 12.100 | 8.712 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 2.500 | 2.219 | 0,03 |
| | | | 57.358 | 0,73 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 38.700 | 38.528 | 0,49 |
| **KANADA** | | | | |
| **Agrium, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.01.2019 | | 4.000 | 4.465 | 0,06 |
| **Canada Government Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (a) | CAD | 8.913 | 7.844 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2016 | | 484 | 353 | 0,00 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 0,933 % fällig am 01.06.2020 | | 10.683 | 7.593 | 0,10 |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | | 27.389 | 19.584 | 0,25 |
| 1,133 % fällig am 01.08.2020 | | 9.904 | 7.080 | 0,09 |
| **CARDS II Trust** | | | | |
| 1,984 % fällig am 15.01.2016 | | 700 | 504 | 0,01 |
| 3,333 % fällig am 15.05.2016 | | 850 | 617 | 0,01 |
| **Export Development Canada** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.03.2017 | NZD | 17.235 | $ 11.921 | 0,15 |
| **Great-West Lifeco, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 18.04.2023 | € | 400 | 462 | 0,01 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 35.400 | 25.380 | 0,32 |
| 2,350 % fällig am 01.06.2025 | | 34.000 | 24.426 | 0,31 |
| **Province of British Columbia** | | | | |
| 4,300 % fällig am 18.06.2042 | | 4.100 | 3.585 | 0,05 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,100 % fällig am 08.09.2018 | | 10.100 | 7.493 | 0,09 |
| 2,450 % fällig am 29.06.2022 | $ | 7.400 | 7.342 | 0,09 |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 | CAD | 400 | 294 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 | | 59.400 | 46.256 | 0,59 |
| 3,450 % fällig am 02.06.2045 | | 18.300 | 13.782 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 07.10.2019 | $ | 11.500 | 12.331 | 0,16 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2017 | CAD | 3.200 | 2.402 | 0,03 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.08.2021 | $ | 24.800 | 25.125 | 0,32 |
| 3,000 % fällig am 01.09.2023 | CAD | 17.000 | 13.070 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 23.300 | 18.511 | 0,24 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | | 15.800 | 13.014 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 01.12.2017 | | 3.200 | 2.466 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2038 | | 11.500 | 10.623 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2041 | | 7.100 | 6.664 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2029 | | 2.300 | 2.248 | 0,03 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 1,800 % fällig am 30.07.2018 | $ | 8.200 | 8.180 | 0,10 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 100 | 95 | 0,00 |
| | | | 303.710 | 3,87 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.05.2021 | $ | 4.280 | 4.277 | 0,05 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 0,601 % fällig am 10.05.2021 | | 58 | 57 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 05.12.2024 | | 9.200 | 9.166 | 0,12 |
| **Cornerstone CLO Ltd.** | | | | |
| 0,541 % fällig am 15.07.2021 | | 4.620 | 4.587 | 0,06 |
| **Doral CLO II Ltd.** | | | | |
| 1,657 % fällig am 26.05.2023 | | 8.543 | 8.532 | 0,11 |
| **Dryden XVI-Leveraged Loan CDO** | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.10.2020 | | 1.161 | 1.157 | 0,02 |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | | 5.811 | 5.802 | 0,07 |
| **Fore CLO Ltd.** | | | | |
| 0,562 % fällig am 20.07.2019 | | 48 | 48 | 0,00 |
| **Inwood Park CDO Ltd.** | | | | |
| 0,542 % fällig am 20.01.2021 | | 149 | 148 | 0,00 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | |
| 1,691 % fällig am 15.07.2023 | | 2.338 | 2.330 | 0,03 |
| **LCM XII LP** | | | | |
| 1,575 % fällig am 19.10.2022 | | 19.000 | 18.878 | 0,24 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,652 % fällig am 15.08.2022 | | 8.300 | 8.282 | 0,11 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 357 | 86 | 0,00 |
| **Symphony CLO VIII LP** | | | | |
| 1,419 % fällig am 09.01.2023 | | 9.735 | 9.690 | 0,12 |
| **Venture XI CLO Ltd.** | | | | |
| 1,662 % fällig am 14.11.2022 | | 2.500 | 2.485 | 0,03 |
| | | | 75.525 | 0,96 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 13.000 | 12.994 | 0,17 |
| **CHINA** | | | | |
| **CNOOC Curtis Funding No.1 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 1.700 | 1.760 | 0,02 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | | 16.300 | 16.875 | 0,22 |
| | | | 18.635 | 0,24 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 23.07.2019 (b) | $ | 9.210 | $ 10.014 | 0,13 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Government Bond** | | | | |
| 0,370 % fällig am 27.10.2016 | CZK | 520.000 | 21.102 | 0,27 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,300 %) fällig am 22.04.2016 | | 222.000 | 8.928 | 0,11 |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | | 335.000 | 13.484 | 0,17 |
| (0,117 %) fällig am 02.09.2016 | | 793.000 | 31.911 | 0,41 |
| | | | 75.425 | 0,96 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2021 | DKK | 3.100 | 523 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.11.2039 | | 200 | 46 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 329.500 | 48.187 | 0,61 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2016 | | 145.000 | 21.427 | 0,27 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.07.2016 | | 819.500 | 119.995 | 1,53 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | | 420.200 | 61.670 | 0,79 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 85.700 | 12.533 | 0,16 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 114.300 | 16.505 | 0,21 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 270.813 | 39.086 | 0,50 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.04.2016 | | 23.900 | 3.487 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 227.900 | 33.174 | 0,42 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 675.300 | 98.727 | 1,26 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 36.100 | 5.234 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 110.006 | 15.888 | 0,20 |
| | | | 476.482 | 6,07 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **Finnvera OYJ** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | € | 12.200 | 13.322 | 0,17 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Banque PSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.02.2016 | | 3.300 | 3.604 | 0,04 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 7.800 | 8.706 | 0,11 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 12.800 | 13.152 | 0,17 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2025 | | 3.000 | 2.883 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | | 18.600 | 18.127 | 0,23 |
| 5,150 % fällig am 21.07.2024 | | 9.400 | 9.495 | 0,12 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 3.254 | 3.426 | 0,04 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 2.000 | 2.906 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 1.500 | 1.539 | 0,02 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 8.945 | 9.894 | 0,13 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 9.300 | 10.872 | 0,14 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | $ | 850 | 835 | 0,01 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | € | 50.500 | 69.760 | 0,89 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2038 | | 17.400 | 26.460 | 0,34 |
| 4,500 % fällig am 25.04.2041 | | 14.200 | 23.439 | 0,30 |
| 4,750 % fällig am 25.04.2035 | | 9.250 | 15.040 | 0,19 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2022 | | 300 | 334 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 17.100 | 18.878 | 0,24 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | | 8.200 | 8.905 | 0,11 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | $ | 5.500 | 5.614 | 0,07 |
| 8,250 % fällig am 29.09.2049 | | 3.400 | 3.613 | 0,05 |
| | | | 257.482 | 3,28 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **KFW** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 1.500 | 1.221 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 19.05.2021 | | 56.330 | 47.601 | 0,61 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | AUD | 4.900 | $ 3.767 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 12.03.2019 | NZD | 27.500 | 19.601 | 0,25 |
| 7,485 % fällig am 15.12.2017 | | 9.000 | 6.664 | 0,08 |
| **Red & Black Auto Germany 2** | | | | |
| 0,281 % fällig am 15.09.2022 | € | 5.174 | 5.626 | 0,07 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2023 (a) | | 9.953 | 11.335 | 0,14 |
| **Land Berlin** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.04.2022 | | 119 | 160 | 0,00 |
| | | | 95.975 | 1,22 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | | 6.000 | 6.085 | 0,08 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | JPY | 941.000 | 7.539 | 0,09 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 6.900 | 6.971 | 0,09 |
| **National Bank of Greece S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.10.2016 | | 11.250 | 11.959 | 0,15 |
| | | | 32.554 | 0,41 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | $ | 1.350 | 1.338 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 6.700 | 6.705 | 0,08 |
| | | | 8.043 | 0,10 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | | 36.000 | 36.403 | 0,46 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 17.10.2023 | | 950 | 990 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 13.03.2020 | | 700 | 761 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 17.01.2018 | | 1.300 | 1.413 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 500 | 587 | 0,01 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 4,300 % fällig am 20.05.2023 | | 700 | 638 | 0,01 |
| | | | 4.389 | 0,06 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 238.255 | 27.540 | 0,35 |
| **Depfa ACS Bank** | | | | |
| 5,125 % fällig am 16.03.2037 | $ | 9.400 | 11.520 | 0,15 |
| **Emerald Mortgages No.4 PLC** | | | | |
| 0,051 % fällig am 15.07.2048 | € | 1.894 | 1.937 | 0,02 |
| **GE Capital International Funding Co.** | | | | |
| 0,964 % fällig am 15.04.2016 | $ | 11.789 | 11.795 | 0,15 |
| 1,363 % fällig am 15.04.2016 | £ | 1.107 | 1.634 | 0,02 |
| **German Postal Pensions Securitisation 2 PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 18.01.2022 | € | 200 | 268 | 0,00 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | | 556 | 609 | 0,01 |
| **Mercator CLO II PLC** | | | | |
| 0,149 % fällig am 18.02.2024 | | 2.146 | 2.315 | 0,03 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (c)** | | 893.540 | 89.890 | 1,14 |
| **PIMCO US Short-Term Fund (c)** | | 285.079 | 2.851 | 0,04 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Willow No.2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.06.2022 | € | 450 | 552 | 0,01 |
| | | | 150.911 | 1,92 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl** | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | | 3.862 | 4.199 | 0,05 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 24.10.2018 | € | 10.700 | $ 12.597 | 0,16 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2016 | | 7.300 | 8.173 | 0,10 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | | 4.295 | 4.695 | 0,06 |
| 2,750 % fällig am 27.07.2020 | | 6.300 | 6.849 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 12.180 | 13.583 | 0,17 |
| **Berica 8 Residential MBS Srl** | | | | |
| 0,229 % fällig am 31.03.2048 | | 17.669 | 18.839 | 0,24 |
| **Berica ABS Srl** | | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | | 1.734 | 1.867 | 0,02 |
| **Claris ABS Srl** | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | | 17.886 | 19.146 | 0,24 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 1.000 | 986 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 12.01.2024 | | 2.000 | 2.146 | 0,03 |
| 7,700 % fällig am 29.12.2049 | | 2.700 | 2.755 | 0,04 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,650 % fällig am 01.11.2020 | € | 3.300 | 3.590 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 01.12.2025 | | 800 | 900 | 0,01 |
| 2,150 % fällig am 12.11.2017 (a) | | 12.639 | 14.246 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 20.425 | 26.340 | 0,34 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 | | 13.300 | 18.031 | 0,23 |
| 4,500 % fällig am 01.05.2023 | | 78.150 | 104.753 | 1,33 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 (b) | | 41.100 | 55.485 | 0,71 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 23.300 | 32.910 | 0,42 |
| 5,000 % fällig am 01.09.2040 | | 24.100 | 37.270 | 0,48 |
| **Mars 2600 Srl** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 583 | 639 | 0,01 |
| **MONVISO SRL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 23.06.2027 | | 13.779 | 14.991 | 0,19 |
| **Republik Italien** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 7.684 | 13.656 | 0,17 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | € | 10.660 | 11.513 | 0,15 |
| 0,649 % fällig am 27.12.2032 | | 18.100 | 19.693 | 0,25 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 9.514 | 10.350 | 0,13 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.06.2019 | £ | 5.000 | 8.018 | 0,10 |
| 7,375 % fällig am 15.12.2017 | | 5.000 | 8.028 | 0,10 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 0,902 % fällig am 10.04.2017 | € | 1.000 | 1.093 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 4.300 | 4.413 | 0,06 |
| | | | 481.754 | 6,13 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 05.03.2018 | $ | 10.500 | 10.418 | 0,13 |
| **Meiji Yasuda Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 20.10.2045 | | 11.500 | 11.861 | 0,15 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.01.2018 | | 400 | 397 | 0,01 |
| | | | 22.676 | 0,29 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 33.250.000 | 300.531 | 3,83 |
| 1,700 % fällig am 20.09.2044 | | 6.950.000 | 63.967 | 0,81 |
| 2,100 % fällig am 20.12.2026 | | 2.300 | 23 | 0,00 |
| 2,200 % fällig am 20.09.2026 | | 200 | 2 | 0,00 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,100 %) fällig am 22.02.2016 | | 22.390.000 | 186.131 | 2,37 |
| (0,086 %) fällig am 07.03.2016 | | 6.550.000 | 54.452 | 0,69 |
| (0,050 %) fällig am 20.01.2016 | | 1.630.000 | 13.550 | 0,17 |
| (0,047 %) fällig am 14.03.2016 | | 59.140.000 | 491.646 | 6,26 |
| | | | 1.110.302 | 14,13 |
| Summe Japan | | | 1.132.978 | 14,42 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **HSBC Capital Funding LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.200 | 3.311 | 0,04 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 7.800 | 7.736 | 0,10 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | $ | 13.500 | $ 13.513 | 0,17 |
| | | | 24.560 | 0,31 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | | 600 | 593 | 0,01 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.03.2022 | | 650 | 652 | 0,01 |
| **DECO Charlemagne S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 27.04.2025 | € | 16.789 | 18.270 | 0,23 |
| **ECAR** | | | | |
| 0,852 % fällig am 18.11.2020 | | 3.143 | 3.416 | 0,04 |
| **Glencore Finance Europe S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.03.2021 | | 400 | 318 | 0,00 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2020 | | 400 | 435 | 0,01 |
| | | | 23.091 | 0,29 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.06.2019 | MXN | 65.500 | 3.791 | 0,05 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | $ | 7.000 | 6.930 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 10.03.2016 | | 400 | 402 | 0,01 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.04.2023 | € | 170 | 192 | 0,00 |
| 3,600 % fällig am 30.01.2025 | $ | 196 | 192 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (a) | MXN | 48.977 | 2.879 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 3.500 | 3.185 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | MXN | 954.800 | 55.616 | 0,71 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | | 75.380 | 4.804 | 0,06 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2026 | € | 8.900 | 8.170 | 0,10 |
| | | | 86.161 | 1,10 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 05.10.2020 | | 9.300 | 10.978 | 0,14 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | $ | 5.800 | 5.760 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | | 700 | 699 | 0,01 |
| **Bank Nederlandse Gemeenten NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.06.2018 | | 2.300 | 2.285 | 0,03 |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | € | 3.594 | 3.872 | 0,05 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.02.2022 | $ | 600 | 634 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 8.450 | 10.946 | 0,14 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 18.878 | 19.480 | 0,25 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 28.408 | 30.601 | 0,39 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.03.2017 | | 300 | 302 | 0,00 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 1.684 | 1.821 | 0,02 |
| **Fiat Chrysler Automobiles NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2020 | $ | 6.100 | 6.207 | 0,08 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.02.2018 | € | 420 | 472 | 0,01 |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 7.600 | 7.486 | 0,10 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2018 | | 1.750 | 1.725 | 0,02 |
| **Panther CDO V BV** | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | € | 4.793 | 5.004 | 0,06 |
| **Schaeffler Holding Finance BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2018 (d) | | 900 | 1.014 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.600.000 | 1.939 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 09.07.2022 | € | 500 | $ 549 | 0,01 |
| | | | 100.796 | 1,28 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **ANZ New Zealand International Ltd.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 23.09.2019 | $ | 5.700 | 5.721 | 0,07 |
| **New Zealand Local Government Funding Agency** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2019 | NZD | 700 | 505 | 0,01 |
| | | | 6.226 | 0,08 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 0,720 % fällig am 28.07.2016 | JPY | 400.000 | 3.314 | 0,04 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | $ | 26.200 | 26.235 | 0,34 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 2.200 | 2.229 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 4.400 | 4.587 | 0,06 |
| **Kommunalbanken** | | | | |
| 4,500 % fällig am 17.04.2023 | AUD | 4.300 | 3.345 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 17.03.2017 | CAD | 2.000 | 1.507 | 0,02 |
| **Norway Government Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 89.400 | 10.355 | 0,13 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | | 78.000 | 10.077 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 22.05.2019 | | 600 | 76 | 0,00 |
| | | | 61.725 | 0,79 |
| **POLEN** | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 31.300 | 8.158 | 0,10 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | € | 6.900 | 1.027 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 1.900 | 282 | 0,01 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 9.290 | 8.869 | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 3.750 | 3.647 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 4.100 | 4.030 | 0,05 |
| | | | 17.855 | 0,23 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 28.10.2024 | | 550 | 619 | 0,01 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | | 27.600 | 30.504 | 0,39 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 51.030 | 53.773 | 0,68 |
| 4,375 % fällig am 18.01.2021 | € | 2.500 | 3.214 | 0,04 |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 33.700 | 38.030 | 0,48 |
| 4,750 % fällig am 10.05.2018 | $ | 8.200 | 8.725 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 77.300 | 85.465 | 1,09 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 14.500 | 16.239 | 0,21 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 8.000 | 9.130 | 0,12 |
| **Slovenska izvozna in razvojna banka dd** | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | € | 13.500 | 14.875 | 0,19 |
| | | | 259.955 | 3,31 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 21.12.2018 | ZAR | 1.100 | 69 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 15.09.2017 | | 142.700 | 9.181 | 0,12 |
| | | | 9.250 | 0,12 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.04.2022 | $ | 1.000 | 1.121 | 0,01 |
| **Republik Korea** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2024 | € | 5.800 | 6.762 | 0,09 |
| 4,125 % fällig am 10.06.2044 | $ | 12.800 | 14.492 | 0,18 |
| | | | 22.375 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SPANIEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 | € | 17.300 | $ 19.033 | 0,24 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 7.100 | 8.160 | 0,10 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 100 | 119 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 3.000 | 3.520 | 0,04 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.09.2026 | | 700 | 912 | 0,01 |
| 4,688 % fällig am 12.03.2020 | | 15.300 | 19.256 | 0,25 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2018 | | 200 | 242 | 0,00 |
| **AyT Hipotecario IV Fondo de Titulizacion Hipotecaria** | | | | |
| 0,135 % fällig am 13.06.2033 | | 1.456 | 1.552 | 0,02 |
| **AYT Hipotecario Mixto IV FTA** | | | | |
| 0,109 % fällig am 20.01.2043 | | 2.298 | 2.373 | 0,03 |
| **Bancaja 4 Fondo de Titulizacion Hipotecaria** | | | | |
| 0,117 % fällig am 18.06.2034 | | 1.269 | 1.333 | 0,02 |
| **Bancaja 6 Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,158 % fällig am 20.02.2036 | | 742 | 781 | 0,01 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 17.400 | 18.526 | 0,24 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 1.600 | 1.719 | 0,02 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | € | 36.800 | 37.680 | 0,48 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 5.100 | 5.197 | 0,07 |
| **Bankinter 13 FTA** | | | | |
| 0,098 % fällig am 17.07.2049 | | 3.561 | 3.696 | 0,05 |
| **Comunidad Autonoma de Aragon** | | | | |
| 1,150 % fällig am 30.07.2017 | | 32.100 | 35.330 | 0,45 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario 1** | | | | |
| 0,131 % fällig am 15.07.2042 | | 5.323 | 5.630 | 0,07 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario 2** | | | | |
| 0,098 % fällig am 18.01.2049 | | 1.539 | 1.587 | 0,02 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos UCI 11** | | | | |
| 0,012 % fällig am 15.09.2041 | | 2.309 | 2.354 | 0,03 |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | | 7.700 | 8.030 | 0,10 |
| **Instituto de Credito Oficial** | | | | |
| 4,530 % fällig am 17.03.2016 | CAD | 2.000 | 1.447 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 10.04.2017 | $ | 4.800 | 4.991 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 31.03.2020 | CAD | 2.000 | 1.606 | 0,02 |
| **MBS Bancaja FTA** | | | | |
| 0,087 % fällig am 17.11.2035 | € | 322 | 345 | 0,00 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 93.800 | 105.376 | 1,34 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 149.000 | 176.717 | 2,25 |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 24.500 | 31.261 | 0,40 |
| 4,400 % fällig am 31.10.2023 | | 800 | 1.062 | 0,01 |
| 4,900 % fällig am 30.07.2040 | | 6.800 | 10.018 | 0,13 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 30.625 | 47.262 | 0,60 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 800 | 1.328 | 0,02 |
| **TDA 15-Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,099 % fällig am 27.06.2042 | € | 398 | 423 | 0,01 |
| **TDA 16-Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,129 % fällig am 22.03.2035 | | 1.421 | 1.503 | 0,02 |
| **TDA 18-Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,139 % fällig am 22.06.2045 | | 96 | 103 | 0,00 |
| **TDA CAM 1 FTA** | | | | |
| 0,119 % fällig am 22.09.2032 | | 1.440 | 1.537 | 0,02 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 5,763 % fällig am 03.04.2017 | | 3.800 | 4.408 | 0,06 |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | | 5.000 | 6.154 | 0,08 |
| | | | 572.571 | 7,29 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| **Rat der Europäischen Entwicklungsbank** | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.04.2018 | NZD | 7.800 | 5.826 | 0,07 |
| **EUROFIMA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 30.06.2020 | AUD | 1.440 | 1.154 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 28.12.2018 | | 8.700 | 6.958 | 0,09 |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.09.2023 | | 5.600 | 3.175 | 0,04 |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | | 4.800 | 2.683 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,500 % fällig am 10.08.2023 | AUD | 10.400 | $ 5.877 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | £ | 53 | 107 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 08.06.2021 | AUD | 1.500 | 1.266 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 15.12.2017 | NZD | 5.100 | 3.767 | 0,05 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2025 | € | 30.300 | 33.438 | 0,43 |
| **International Bank for Reconstruction & Development** | | | | |
| 4,500 % fällig am 16.08.2016 | NZD | 16.500 | 11.404 | 0,15 |
| **International Finance Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.11.2017 | $ | 125 | 127 | 0,00 |
| **Nordic Investment Bank** | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.04.2022 | AUD | 13.000 | 10.436 | 0,13 |
| | | | 86.218 | 1,10 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 4,250 % fällig am 10.10.2017 | | 33.000 | 24.529 | 0,31 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.07.2017 | € | 1.300 | 1.484 | 0,02 |
| **Swedbank AB** | | | | |
| 2,200 % fällig am 04.03.2020 | $ | 20.200 | 19.979 | 0,25 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | SEK | 50.300 | 6.402 | 0,08 |
| **Sweden Government Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.07.2016 | | 500 | 60 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 12.03.2019 | | 124.500 | 16.842 | 0,22 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2020 | | 500 | 73 | 0,00 |
| | | | 69.369 | 0,88 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 32.412 | 34.999 | 0,45 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | | 900 | 916 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 6.400 | 6.480 | 0,08 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 33.190 | 34.724 | 0,44 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 625 | 713 | 0,01 |
| | | | 77.832 | 0,99 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **Abu Dhabi National Energy Co. PJSC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 12.01.2018 | | 7.800 | 7.770 | 0,10 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Penarth Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,760 % fällig am 18.05.2019 | | 1.050 | 1.047 | 0,01 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Virgin Media Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.06.2023 | | 43.295 | 42.447 | 0,54 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 27.06.2016 | € | 700 | 781 | 0,01 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 10.05.2017 | $ | 450 | 455 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 40.895 | 46.646 | 0,59 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 16.090 | 17.196 | 0,22 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | | 3.900 | 3.755 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 4.500 | 4.964 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2049 | $ | 200 | 198 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 14.300 | 21.119 | 0,27 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 14.700 | 17.359 | 0,22 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 28.06.2016 | $ | 200 | 200 | 0,00 |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | | 959 | 1.403 | 0,02 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | £ | 2.800 | 4.505 | 0,06 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | € | 500 | 553 | 0,01 |
| **Hammerson PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.07.2022 | | 400 | 443 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **HBOS PLC** | | | | |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | $ | 5.600 | $ 5.588 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 21.05.2018 | | 20.850 | 22.792 | 0,29 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.09.2019 | £ | 9.600 | 15.175 | 0,19 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.03.2046 | | 600 | 913 | 0,01 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 22.500 | 24.665 | 0,31 |
| **LBG Capital No.1 PLC** | | | | |
| 2,975 % fällig am 12.03.2020 | | 1.205 | 1.329 | 0,02 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 17.08.2020 | $ | 400 | 403 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 18.300 | 32.094 | 0,41 |
| 6,000 % fällig am 08.02.2029 | | 150 | 295 | 0,00 |
| 9,875 % fällig am 16.12.2021 | $ | 8.087 | 8.659 | 0,11 |
| 10,375 % fällig am 12.02.2024 | € | 5.619 | 7.693 | 0,10 |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 900 | 1.284 | 0,02 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 11.120 | 17.207 | 0,22 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 1.880 | 2.941 | 0,04 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 02.04.2024 | | 3.200 | 5.024 | 0,06 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 62 | 118 | 0,00 |
| **Pearson Dollar Finance Two PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 06.05.2018 | $ | 13.000 | 14.036 | 0,18 |
| **Premier Foods Finance PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2021 | £ | 400 | 564 | 0,01 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 26.200 | 28.422 | 0,36 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 1.800 | 1.442 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 5.600 | 5.553 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 11.900 | 17.860 | 0,23 |
| **Sky PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.09.2021 | € | 400 | 437 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.09.2026 | | 300 | 331 | 0,00 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.07.2019 | | 11.600 | 12.142 | 0,15 |
| **Tesco Property Finance 4 PLC** | | | | |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | £ | 3.357 | 4.335 | 0,06 |
| | | | 350.879 | 4,47 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 0,753 % fällig am 15.12.2038 | | 9.974 | 13.365 | 0,17 |
| 1,754 % fällig am 24.04.2049 | | 14.430 | 21.056 | 0,27 |
| 2,832 % fällig am 16.12.2042 | | 63 | 94 | 0,00 |
| **Auburn Securities 9 PLC** | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 14.188 | 20.788 | 0,26 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | | 26.981 | 39.056 | 0,50 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,044 % fällig am 10.12.2044 | € | 649 | 674 | 0,01 |
| 0,112 % fällig am 15.12.2044 | | 200 | 181 | 0,00 |
| 0,743 % fällig am 10.06.2044 | £ | 8.845 | 12.658 | 0,16 |
| 0,743 % fällig am 10.12.2044 | | 1.136 | 1.610 | 0,02 |
| **Gemgarto** | | | | |
| 3,523 % fällig am 14.05.2045 | | 4.373 | 6.534 | 0,08 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | | 533 | 788 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | € | 1.298 | 1.340 | 0,02 |
| 0,017 % fällig am 18.06.2038 | | 1.689 | 1.740 | 0,02 |
| 0,826 % fällig am 18.03.2039 | £ | 4.670 | 5.435 | 0,07 |
| **Leek Finance Number Eighteen PLC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 21.09.2038 | $ | 128 | 135 | 0,00 |
| **Leofric No. 1 PLC** | | | | |
| 2,270 % fällig am 26.05.2050 | £ | 6.897 | 10.250 | 0,13 |
| **Logistics UK PLC** | | | | |
| 1,821 % fällig am 20.08.2025 | | 3.800 | 5.618 | 0,07 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,119 % fällig am 01.01.2061 | € | 687 | 677 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | £ | 21.431 | 30.447 | 0,39 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,199 % fällig am 01.12.2050 | € | 3.700 | $ 3.250 | 0,04 |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | | 1.069 | 1.077 | 0,01 |
| 0,749 % fällig am 01.12.2050 | £ | 1.147 | 1.550 | 0,02 |
| 1,122 % fällig am 15.12.2050 | € | 5.481 | 5.256 | 0,07 |
| 1,372 % fällig am 15.12.2050 | | 7.869 | 7.359 | 0,09 |
| 1,583 % fällig am 15.12.2050 | £ | 5.658 | 7.606 | 0,10 |
| 1,833 % fällig am 15.12.2050 | | 6.012 | 7.679 | 0,10 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,117 % fällig am 01.12.2050 | € | 880 | 894 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages No.10 PLC** | | | | |
| 0,192 % fällig am 15.06.2041 | | 500 | 482 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 17.260 | 22.851 | 0,29 |
| **Preferred Residential Securities 7 PLC** | | | | |
| 1,683 % fällig am 15.12.2041 | | 725 | 979 | 0,01 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,025 % fällig am 12.06.2044 | € | 2.275 | 2.250 | 0,03 |
| 0,125 % fällig am 12.06.2044 | | 1.847 | 1.775 | 0,02 |
| **ResLoC UK PLC** | | | | |
| 0,803 % fällig am 15.12.2043 | £ | 5.825 | 7.262 | 0,09 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 2,433 % fällig am 10.12.2042 | | 1.021 | 1.313 | 0,02 |
| **Taurus GMF1 PLC** | | | | |
| 0,958 % fällig am 21.05.2024 | € | 384 | 421 | 0,01 |
| **Tenterden Funding PLC** | | | | |
| 2,085 % fällig am 21.03.2044 | £ | 10.284 | 15.309 | 0,20 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,101 % fällig am 10.10.2040 | € | 3.179 | 3.429 | 0,04 |
| | | | 263.188 | 3,35 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % fällig am 29.06.2049 | | 42.300 | 8.076 | 0,10 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | £ | 25 | 37 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (b) | | 48.800 | 80.176 | 1,02 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 10.200 | 17.561 | 0,22 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2027 | | 19 | 34 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 (b) | | 19.700 | 37.552 | 0,48 |
| 4,750 % fällig am 07.03.2020 | | 24 | 41 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 (b) | | 5.600 | 11.296 | 0,15 |
| | | | 146.697 | 1,87 |
| Summe Großbritannien | | | 812.334 | 10,34 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,081 % fällig am 15.06.2045 | $ | 200 | 202 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,422 % fällig am 15.12.2033 | € | 2.471 | 2.318 | 0,03 |
| 1,820 % fällig am 25.04.2023 | $ | 12.599 | 12.619 | 0,16 |
| | | | 15.139 | 0,19 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Chrysler Group LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.12.2018 | | 4.937 | 4.901 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 4.937 | 4.937 | 0,07 |
| **Numericable US LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.05.2020 | | 9.787 | 9.460 | 0,12 |
| | | | 19.298 | 0,25 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABB Treasury Center USA, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.06.2016 | | 650 | 653 | 0,01 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | | 4.100 | 3.973 | 0,05 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2021 | | 400 | 420 | 0,01 |
| **AES Corp.** | | | | |
| 3,414 % fällig am 01.06.2019 | $ | 350 | $ 322 | 0,00 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.03.2017 (l) | | 20.400 | 19.996 | 0,26 |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 14.700 | 14.700 | 0,19 |
| 2,995 % fällig am 18.07.2016 | | 3.050 | 3.050 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 300 | 300 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 17.850 | 17.939 | 0,23 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 500 | 501 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 1.300 | 1.342 | 0,02 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2022 | | 350 | 379 | 0,01 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.05.2024 | | 250 | 250 | 0,00 |
| 5,700 % fällig am 01.02.2019 | | 11.400 | 12.577 | 0,16 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 05.09.2023 | € | 200 | 210 | 0,00 |
| 2,400 % fällig am 15.03.2024 | | 100 | 113 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | 574 | 0,01 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | $ | 21.284 | 24.397 | 0,31 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,003 % fällig am 25.08.2017 | | 9.000 | 8.990 | 0,11 |
| 1,700 % fällig am 25.08.2017 | | 3.500 | 3.491 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 22.03.2017 | | 1.050 | 1.073 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 01.09.2017 | | 1.495 | 1.592 | 0,02 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 5.000 | 5.358 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 4.350 | 4.802 | 0,06 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.11.2016 | | 29.500 | 29.447 | 0,38 |
| **Burlington Northern Santa Fe LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2018 | | 149 | 161 | 0,00 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 2.648 | 957 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 1.172 | 375 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 10.243 | 5.416 | 0,07 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 19.200 | 19.155 | 0,24 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 1.200 | 1.201 | 0,02 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 26.900 | 27.238 | 0,35 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.04.2017 | | 1.200 | 1.246 | 0,02 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 1.200 | 339 | 0,00 |
| **Cigna Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2025 | | 1.150 | 1.131 | 0,01 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | | 1.700 | 1.743 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | | 1.100 | 1.136 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 300 | 311 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2019 | | 100 | 105 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2018 | | 500 | 529 | 0,01 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,013 % fällig am 27.04.2018 | | 32.900 | 32.786 | 0,42 |
| 3,750 % fällig am 16.06.2024 | | 1.300 | 1.326 | 0,02 |
| **Cleveland Electric Illuminating Co.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 01.04.2017 | | 38 | 39 | 0,00 |
| **Coca-Cola Co.** | | | | |
| 0,117 % fällig am 09.09.2019 | € | 350 | 379 | 0,01 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.07.2022 | $ | 750 | 763 | 0,01 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.06.2018 | | 200 | 200 | 0,00 |
| 3,050 % fällig am 15.08.2022 | | 350 | 346 | 0,00 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.03.2018 | | 12.000 | 12.061 | 0,15 |
| **Ford Motor Co.** | | | | |
| 7,450 % fällig am 16.07.2031 | | 200 | 247 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,594 % fällig am 09.05.2016 | | 1.000 | 1.001 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 12.06.2017 | | 1.000 | 1.010 | 0,01 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 09.10.2022 | | 450 | 449 | 0,01 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 02.10.2023 | | 450 | 462 | 0,01 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 1.600 | 1.605 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Gilead Sciences, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.04.2024 | $ | 450 | $ 461 | 0,01 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.06.2026 | € | 750 | 875 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | $ | 8.000 | 8.069 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 21.08.2019 | AUD | 3.700 | 2.811 | 0,04 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | $ | 700 | 710 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 12.400 | 12.756 | 0,16 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 6.000 | 6.405 | 0,08 |
| 8,875 % fällig am 01.09.2017 | | 300 | 327 | 0,00 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,300 % fällig am 16.04.2019 | | 15.500 | 15.393 | 0,20 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 1.500 | 1.339 | 0,02 |
| **John Deere Capital Corp.** | | | | |
| 1,400 % fällig am 15.03.2017 | | 400 | 401 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 31.400 | 31.559 | 0,40 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2025 | | 650 | 633 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 14.200 | 14.650 | 0,19 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc. (e)** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2010 | | 8.800 | 664 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 | | 12.700 | 953 | 0,01 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 | | 9.800 | 747 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 | £ | 14.000 | 1.857 | 0,02 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 03.10.2016 | $ | 59 | 61 | 0,00 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 2,000 % fällig am 14.04.2020 | | 11.900 | 11.664 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 16.05.2017 | € | 1.250 | 1.441 | 0,02 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.06.2016 | $ | 3.200 | 3.267 | 0,04 |
| 7,625 % fällig am 15.01.2017 | | 6.300 | 6.583 | 0,08 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 1.412 | 1.415 | 0,02 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 12.08.2023 | | 2.700 | 3.160 | 0,04 |
| **PHH Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | | 3.615 | 3.308 | 0,04 |
| **PNC Financial Services Group, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 29.04.2024 | | 700 | 718 | 0,01 |
| **PPG Industries, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 13.03.2022 | € | 800 | 847 | 0,01 |
| **PPL Capital Funding, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.03.2024 | $ | 300 | 308 | 0,00 |
| **Prudential Financial, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.05.2024 | | 950 | 956 | 0,01 |
| **Public Service Electric & Gas Co.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.05.2023 | | 1.550 | 1.485 | 0,02 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 20.05.2022 | | 7.350 | 7.283 | 0,09 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 6.700 | 5.863 | 0,08 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.06.2024 | | 900 | 897 | 0,01 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2020 | | 3.700 | 3.529 | 0,05 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 100 | 75 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 800 | 800 | 0,01 |
| 8,375 % fällig am 15.08.2017 | | 11.600 | 11.443 | 0,15 |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | | 23.150 | 23.613 | 0,30 |
| **Starbucks Corp.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.10.2023 | | 1.000 | 1.062 | 0,01 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2021 | | 1.400 | 1.358 | 0,02 |
| **Time Warner, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.04.2031 | | 117 | 145 | 0,00 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2025 | | 16.900 | 17.443 | 0,22 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.02.2022 | € | 300 | 348 | 0,00 |
| 4,522 % fällig am 15.09.2048 | $ | 1.835 | 1.648 | 0,02 |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | | 1.586 | 1.507 | 0,02 |
| 6,400 % fällig am 15.09.2033 | | 112 | 128 | 0,00 |
| **Vesey Street Investment Trust I** | | | | |
| 4,404 % fällig am 01.09.2016 | $ | 5.100 | $ 5.200 | 0,07 |
| **Viacom, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 01.04.2019 | | 1.800 | 1.769 | 0,02 |
| **Wal-Mart Stores, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 08.07.2040 | | 350 | 376 | 0,01 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | | 15.700 | 15.670 | 0,20 |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | | 12.900 | 12.562 | 0,16 |
| **Williams Partners LP** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.01.2025 | | 250 | 188 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.03.2024 | | 400 | 321 | 0,00 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 18.100 | 17.622 | 0,22 |
| | | | 536.839 | 6,83 |

**MORTGAGE-BACKED SECURITIES**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.10.2036 | 10 | 5 | 0,00 |
| 1,217 % fällig am 25.01.2035 | 1.579 | 1.465 | 0,02 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2034 | 1.898 | 1.717 | 0,02 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 1,572 % fällig am 25.03.2035 | 1.572 | 1.358 | 0,02 |
| 2,757 % fällig am 25.09.2035 | 421 | 352 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,842 % fällig am 25.06.2035 | 29 | 29 | 0,00 |
| **AFC Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,132 % fällig am 22.12.2027 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2047 | 478 | 401 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 20.02.2047 (e) | 16.970 | 12.808 | 0,16 |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (e) | 9.425 | 7.030 | 0,09 |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | 3.298 | 2.505 | 0,03 |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (e) | 790 | 580 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.05.2036 | 180 | 144 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2035 | 110 | 92 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.07.2046 (e) | 173 | 137 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 20.09.2046 | 1.411 | 597 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2037 | 3.027 | 2.374 | 0,03 |
| 0,733 % fällig am 20.11.2035 | 1.902 | 1.617 | 0,02 |
| 0,762 % fällig am 25.10.2046 (e) | 584 | 68 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2037 (e) | 1.370 | 836 | 0,01 |
| 1,192 % fällig am 25.11.2035 | 851 | 736 | 0,01 |
| 1,674 % fällig am 25.11.2035 | 1.096 | 899 | 0,01 |
| 2,214 % fällig am 25.11.2035 | 847 | 716 | 0,01 |
| 2,592 % fällig am 25.10.2035 (e) | 170 | 155 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 (e) | 667 | 616 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 (e) | 569 | 511 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (e) | 375 | 294 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 (e) | 353 | 334 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 (e) | 1.038 | 889 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 140 | 141 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust (e)** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.05.2046 | 838 | 618 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 | 2.260 | 1.622 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,279 % fällig am 25.09.2035 | 1.167 | 1.160 | 0,02 |
| 2,314 % fällig am 25.10.2034 | 351 | 351 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.02.2045 | 7 | 8 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | 1.000 | 977 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.09.2035 | 2.000 | 1.843 | 0,02 |
| 1,022 % fällig am 25.08.2035 | 1.119 | 1.110 | 0,01 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 1.007 | 898 | 0,01 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 0,921 % fällig am 25.10.2031 | 90 | 83 | 0,00 |
| 1,002 % fällig am 25.07.2032 | 68 | 63 | 0,00 |
| **Amresco Residential Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,362 % fällig am 25.06.2029 | 52 | 49 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 1,122 % fällig am 25.06.2034 | 547 | 513 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2034 | 2.004 | 1.970 | 0,03 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,801 % fällig am 20.02.2036 | 2.515 | 2.501 | 0,03 |
| 2,870 % fällig am 20.11.2035 (e) | 307 | 275 | 0,00 |
| 3,007 % fällig am 20.01.2047 (e) | 533 | 452 | 0,01 |
| 3,203 % fällig am 20.10.2046 (e) | $ 319 | $ 242 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | 47 | 50 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,799 % fällig am 25.09.2033 | 34 | 34 | 0,00 |
| 2,871 % fällig am 25.09.2035 | 332 | 307 | 0,00 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | |
| 5,651 % fällig am 17.02.2051 | 434 | 440 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 (e) | 81 | 65 | 0,00 |
| 0,983 % fällig am 26.01.2047 | 1.736 | 1.539 | 0,02 |
| 2,607 % fällig am 26.02.2036 | 748 | 754 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | 2.529 | 2.333 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 26.08.2037 | 2.590 | 2.698 | 0,04 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,458 % fällig am 25.05.2034 | 313 | 291 | 0,00 |
| 2,480 % fällig am 25.08.2035 | 4.147 | 4.167 | 0,05 |
| 2,601 % fällig am 25.08.2033 | 31 | 31 | 0,00 |
| 2,608 % fällig am 25.10.2033 | 242 | 245 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 25.08.2033 | 341 | 344 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | 2.120 | 2.130 | 0,03 |
| 2,697 % fällig am 25.05.2034 | 439 | 428 | 0,01 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (e) | 569 | 514 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2034 | 53 | 52 | 0,00 |
| 2,919 % fällig am 25.08.2035 | 5.234 | 5.179 | 0,07 |
| 2,924 % fällig am 25.03.2035 | 604 | 612 | 0,01 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2034 | 203 | 186 | 0,00 |
| 2,457 % fällig am 25.03.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,601 % fällig am 25.05.2035 | 206 | 203 | 0,00 |
| 2,602 % fällig am 25.08.2036 (e) | 28 | 21 | 0,00 |
| 2,608 % fällig am 25.01.2036 | 8.671 | 7.513 | 0,10 |
| 2,702 % fällig am 25.11.2036 (e) | 6.305 | 4.574 | 0,06 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | 6.122 | 5.207 | 0,07 |
| 2,741 % fällig am 25.11.2035 (e) | 1.865 | 1.402 | 0,02 |
| 2,956 % fällig am 25.08.2036 (e) | 2.925 | 2.199 | 0,03 |
| 4,193 % fällig am 25.11.2036 (e) | 1.239 | 901 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,832 % fällig am 25.12.2035 | 1.100 | 1.074 | 0,01 |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | 5.440 | 5.061 | 0,07 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 1,062 % fällig am 25.12.2034 | 45 | 43 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.10.2032 | 18 | 17 | 0,00 |
| 1,422 % fällig am 25.11.2042 | 28 | 26 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | 5.344 | 3.955 | 0,05 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.05.2037 | 556 | 542 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 2,466 % fällig am 25.03.2037 (e) | 2.632 | 2.471 | 0,03 |
| 2,702 % fällig am 25.02.2037 | 1.178 | 1.199 | 0,02 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2022 | 52 | 52 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (e) | 327 | 313 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,081 % fällig am 15.06.2033 | 550 | 545 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2045 | 46 | 32 | 0,00 |
| 1,142 % fällig am 25.09.2035 (e) | 1.300 | 1.237 | 0,02 |
| 2,420 % fällig am 25.09.2035 | 1.693 | 1.704 | 0,02 |
| 2,430 % fällig am 25.09.2035 | 90 | 90 | 0,00 |
| 2,660 % fällig am 25.05.2035 | 48 | 48 | 0,00 |
| 2,706 % fällig am 25.08.2035 | 819 | 814 | 0,01 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2035 | 76 | 76 | 0,00 |
| 3,641 % fällig am 25.08.2035 (e) | 1.740 | 1.487 | 0,02 |
| 5,764 % fällig am 25.01.2037 (e) | 252 | 168 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,399 % fällig am 25.09.2035 (e) | 3.096 | 2.685 | 0,03 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 0,584 % fällig am 10.03.2046 (f) | 21.812 | 808 | 0,01 |
| 1,742 % fällig am 10.01.2046 (f) | 25.408 | 1.749 | 0,02 |
| 2,365 % fällig am 10.02.2029 | 300 | 302 | 0,00 |
| **Conseco Finance Securitizations Corp.** | | | |
| 6,030 % fällig am 01.03.2033 | 78 | 79 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.09.2036 | 493 | 488 | 0,01 |
| 0,701 % fällig am 25.12.2031 (e) | 83 | 60 | 0,00 |
| 0,762 % fällig am 25.12.2036 (e) | 353 | 247 | 0,00 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 618 | 590 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 1,142 % fällig am 25.07.2034 | $ 762 | $ 709 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | 1.348 | 1.155 | 0,02 |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | 186 | 161 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | 4.601 | 3.715 | 0,05 |
| 0,772 % fällig am 25.02.2036 (e) | 152 | 131 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.02.2035 | 762 | 706 | 0,01 |
| 1,102 % fällig am 25.02.2035 | 334 | 294 | 0,00 |
| 1,182 % fällig am 25.09.2034 | 132 | 122 | 0,00 |
| 2,390 % fällig am 25.04.2035 | 456 | 382 | 0,01 |
| 2,419 % fällig am 19.01.2034 | 151 | 142 | 0,00 |
| 2,484 % fällig am 20.04.2036 | 5.734 | 5.223 | 0,07 |
| 2,593 % fällig am 20.02.2036 (e) | 109 | 102 | 0,00 |
| 2,646 % fällig am 25.11.2034 | 692 | 660 | 0,01 |
| 2,713 % fällig am 25.08.2034 (e) | 227 | 199 | 0,00 |
| 2,725 % fällig am 20.02.2036 (e) | 220 | 194 | 0,00 |
| 2,745 % fällig am 19.11.2033 | 50 | 49 | 0,00 |
| 2,766 % fällig am 25.08.2034 (e) | 143 | 127 | 0,00 |
| 3,029 % fällig am 25.09.2033 (e) | 27 | 25 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (e) | 341 | 323 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 0,824 % fällig am 25.03.2032 | 116 | 108 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | 46 | 40 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 25.07.2033 | 54 | 54 | 0,00 |
| 2,596 % fällig am 25.08.2033 | 415 | 417 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2033 | 38 | 39 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | |
| 5,777 % fällig am 16.12.2049 | 4.117 | 4.195 | 0,05 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,579 % fällig am 25.04.2037 (e) | 105 | 58 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | 28 | 16 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,172 % fällig am 25.06.2036 (e) | 432 | 265 | 0,00 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | |
| 1,127 % fällig am 10.11.2046 (f) | 7.288 | 163 | 0,00 |
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,971 % fällig am 15.08.2030 | 31 | 28 | 0,00 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust (e)** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 | 6.554 | 5.288 | 0,07 |
| 0,722 % fällig am 25.09.2047 | 10.195 | 7.948 | 0,10 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,050 % fällig am 25.10.2035 | 452 | 371 | 0,01 |
| **Deutsche Alternative-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.10.2036 (e) | 25 | 16 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | |
| 2,740 % fällig am 26.06.2035 | 583 | 581 | 0,01 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,961 % fällig am 25.05.2040 | 28 | 26 | 0,00 |
| **Extended Stay America Trust** | | | |
| 1,079 % fällig am 05.12.2031 (f) | 59.000 | 50 | 0,00 |
| 2,958 % fällig am 05.12.2031 | 5.900 | 5.918 | 0,08 |
| **FHLMC Multifamily Structured Pass-Through Certificates (f)** | | | |
| 0,889 % fällig am 25.09.2022 | 39.662 | 1.880 | 0,02 |
| 1,041 % fällig am 25.11.2022 | 54.752 | 3.130 | 0,04 |
| 1,286 % fällig am 25.08.2019 | 63.530 | 2.655 | 0,03 |
| 1,370 % fällig am 25.11.2019 | 57.630 | 2.626 | 0,03 |
| 1,599 % fällig am 25.04.2017 | 46.523 | 617 | 0,01 |
| 1,645 % fällig am 25.06.2020 | 55.335 | 2.969 | 0,04 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.08.2031 | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.09.2031 | 168 | 166 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 25.10.2044 | 3.375 | 3.433 | 0,04 |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | 249 | 254 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 25.07.2044 | 90 | 91 | 0,00 |
| **First Alliance Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 20.12.2027 | 10 | 10 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | 2.978 | 2.795 | 0,04 |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | 170 | 169 | 0,00 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,376 % fällig am 25.04.2035 | 411 | 406 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 (e) | 445 | 351 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,612 % fällig am 25.06.2035 | $ 737 | $ 718 | 0,01 |
| 2,723 % fällig am 25.08.2035 | 346 | 309 | 0,00 |
| **First Republic Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,681 % fällig am 15.11.2031 | 274 | 263 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 1,487 % fällig am 25.06.2035 | 8.000 | 6.889 | 0,09 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,089 % fällig am 25.06.2034 | 71 | 70 | 0,00 |
| **GRACE Mortgage Trust** | | | |
| 3,369 % fällig am 10.06.2028 | 650 | 667 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.01.2037 | 1.832 | 1.488 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2036 | 1.106 | 837 | 0,01 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 (e) | 174 | 115 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.11.2045 | 254 | 221 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.09.2046 (e) | 1.045 | 568 | 0,01 |
| 0,762 % fällig am 25.10.2046 (e) | 1.332 | 760 | 0,01 |
| **Greenpoint Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,865 % fällig am 25.10.2033 | 69 | 68 | 0,00 |
| **GreenPoint MTA Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2045 | 175 | 155 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp. II (f)** | | | |
| 1,620 % fällig am 10.02.2046 | 16.204 | 1.350 | 0,02 |
| 2,329 % fällig am 10.11.2045 | 83.331 | 8.040 | 0,10 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.03.2037 | 638 | 388 | 0,01 |
| **GSAA Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.05.2047 | 429 | 317 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,860 % fällig am 25.03.2033 | 240 | 236 | 0,00 |
| 2,010 % fällig am 25.04.2032 | 276 | 255 | 0,00 |
| 2,261 % fällig am 25.06.2034 | 82 | 78 | 0,00 |
| 2,806 % fällig am 25.09.2035 | 269 | 276 | 0,00 |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (e) | 245 | 230 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 | 1.591 | 1.568 | 0,02 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,443 % fällig am 19.03.2036 | 395 | 286 | 0,00 |
| 0,453 % fällig am 19.01.2036 | 845 | 576 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 19.09.2037 | 1.625 | 1.308 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 19.09.2046 | 1.928 | 1.450 | 0,02 |
| 0,652 % fällig am 19.09.2046 (e) | 28 | 2 | 0,00 |
| 1,102 % fällig am 19.01.2035 | 435 | 310 | 0,00 |
| 1,107 % fällig am 19.12.2036 (e) | 877 | 735 | 0,01 |
| 1,142 % fällig am 19.02.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 1,152 % fällig am 19.10.2035 | 639 | 540 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 19.05.2033 | 432 | 429 | 0,01 |
| 2,685 % fällig am 19.07.2035 | 192 | 171 | 0,00 |
| 4,730 % fällig am 19.08.2036 (e) | 672 | 607 | 0,01 |
| **Hilton USA Trust** | | | |
| 2,662 % fällig am 05.11.2030 | 13.700 | 13.731 | 0,18 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.08.2036 | 1.200 | 1.031 | 0,01 |
| 1,342 % fällig am 25.02.2033 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (e) | 570 | 308 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.12.2036 | 70 | 62 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.10.2035 | 4.642 | 4.323 | 0,06 |
| 0,752 % fällig am 25.10.2035 | 1.315 | 1.230 | 0,02 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 (e) | 299 | 260 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.02.2036 | 3.700 | 3.243 | 0,04 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 1,422 % fällig am 25.07.2033 | 50 | 49 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,461 % fällig am 25.06.2037 | 479 | 416 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.06.2046 | 3.130 | 2.395 | 0,03 |
| 2,652 % fällig am 25.08.2035 (e) | 293 | 242 | 0,00 |
| 2,656 % fällig am 25.03.2036 | 1.384 | 1.056 | 0,01 |
| 2,668 % fällig am 25.03.2036 (e) | 5.771 | 4.508 | 0,06 |
| 2,691 % fällig am 25.12.2034 | 246 | 235 | 0,00 |
| 2,757 % fällig am 25.01.2036 (e) | 394 | 331 | 0,00 |
| 2,843 % fällig am 25.10.2035 | 303 | 254 | 0,00 |
| 4,182 % fällig am 25.06.2036 | 562 | 520 | 0,01 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,263 % fällig am 15.04.2047 (f) | 73.129 | 3.464 | 0,04 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust (e)** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 | $ 11 | $ 8 | 0,00 |
| 5,780 % fällig am 25.12.2036 | 8.446 | 8.150 | 0,10 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,269 % fällig am 15.12.2047 (f) | 115.828 | 6.845 | 0,09 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.08.2036 | 7.888 | 4.024 | 0,05 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,104 % fällig am 25.11.2033 | 299 | 291 | 0,00 |
| 2,429 % fällig am 25.12.2034 | 1.719 | 1.722 | 0,02 |
| 2,463 % fällig am 25.06.2036 | 985 | 893 | 0,01 |
| 2,609 % fällig am 25.02.2036 (e) | 658 | 577 | 0,01 |
| 2,685 % fällig am 25.07.2035 | 243 | 242 | 0,00 |
| 2,726 % fällig am 25.07.2035 | 749 | 742 | 0,01 |
| 2,741 % fällig am 25.08.2034 | 831 | 836 | 0,01 |
| 2,746 % fällig am 25.02.2036 (e) | 2.010 | 1.788 | 0,02 |
| 2,773 % fällig am 25.08.2035 | 1.053 | 1.059 | 0,01 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,512 % fällig am 25.06.2037 | 183 | 113 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust (e)** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.04.2037 | 436 | 333 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.09.2046 | 68 | 14 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,982 % fällig am 25.10.2034 | 535 | 504 | 0,01 |
| 1,247 % fällig am 25.06.2035 | 1.193 | 1.187 | 0,02 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | |
| 0,401 % fällig am 25.12.2036 (e) | 1.538 | 1.270 | 0,02 |
| 0,622 % fällig am 25.10.2046 | 1.311 | 1.127 | 0,02 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 2,772 % fällig am 21.11.2034 | 487 | 499 | 0,01 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.03.2036 (e) | 818 | 203 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,031 % fällig am 15.11.2031 | 322 | 304 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,771 % fällig am 15.12.2030 | 266 | 256 | 0,00 |
| 2,609 % fällig am 20.10.2029 | 76 | 76 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | 14.714 | 6.765 | 0,09 |
| **Merrill Lynch CFC Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,877 % fällig am 12.08.2049 | 14.449 | 15.072 | 0,19 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 0,502 % fällig am 25.09.2037 | 23 | 9 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2036 | 129 | 127 | 0,00 |
| 0,902 % fällig am 25.05.2036 | 1.769 | 1.629 | 0,02 |
| 1,082 % fällig am 25.06.2028 | 99 | 95 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.10.2035 | 2.131 | 2.076 | 0,03 |
| 2,239 % fällig am 25.12.2034 | 902 | 906 | 0,01 |
| 2,289 % fällig am 25.02.2033 | 403 | 388 | 0,01 |
| 2,430 % fällig am 25.06.2037 | 560 | 539 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,040 % fällig am 25.04.2037 (e) | 2.378 | 2.032 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.05.2037 | 705 | 451 | 0,01 |
| 1,222 % fällig am 25.07.2037 | 162 | 160 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust (f)** | | | |
| 1,446 % fällig am 15.12.2048 | 69.606 | 3.420 | 0,04 |
| 1,663 % fällig am 15.02.2046 | 75.403 | 5.443 | 0,07 |
| 1,802 % fällig am 15.08.2045 | 9.783 | 667 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | |
| 3,350 % fällig am 13.07.2029 | 1.250 | 1.278 | 0,02 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 0,472 % fällig am 25.11.2036 | 3 | 1 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.01.2047 (e) | 9 | 9 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 25.02.2037 | 364 | 199 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.04.2035 | 2.077 | 1.947 | 0,03 |
| 0,782 % fällig am 25.04.2037 | 516 | 261 | 0,00 |
| 2,891 % fällig am 25.11.2035 (e) | 226 | 191 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 (e) | 200 | 149 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2047 (e) | 387 | 309 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | |
| 5,794 % fällig am 12.08.2045 | 85 | 88 | 0,00 |
| **NCUA Guaranteed Notes Trust** | | | |
| 0,646 % fällig am 06.11.2017 | 25.150 | 25.192 | 0,32 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,716 % fällig am 25.10.2035 | $ 117 | $ 110 | 0,00 |
| **OBP Depositor LLC Trust** | | | |
| 4,646 % fällig am 15.07.2045 | 300 | 324 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.01.2036 | 4.025 | 3.928 | 0,05 |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | 1.000 | 845 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | 3.278 | 2.305 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | 2.000 | 1.880 | 0,02 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,512 % fällig am 25.06.2047 (e) | 125 | 125 | 0,00 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.06.2047 | 449 | 428 | 0,01 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,922 % fällig am 25.12.2033 | 295 | 277 | 0,00 |
| 1,122 % fällig am 25.08.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 (e) | 208 | 209 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | 853 | 467 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2047 | 7.645 | 6.088 | 0,08 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2046 | 5.669 | 2.423 | 0,03 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2046 | 5.078 | 2.420 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2037 | 2.204 | 1.740 | 0,02 |
| 3,174 % fällig am 25.08.2035 (e) | 57 | 30 | 0,00 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | 1.261 | 1.249 | 0,02 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2035 | 1.068 | 1.054 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.07.2032 (e) | 111 | 99 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,982 % fällig am 25.06.2032 | 82 | 77 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.01.2046 (e) | 20 | 10 | 0,00 |
| 0,872 % fällig am 25.12.2036 (e) | 727 | 206 | 0,00 |
| 0,922 % fällig am 25.03.2035 | 1.615 | 1.325 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 4.973 | 4.504 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 25.10.2036 (e) | 676 | 567 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 (e) | 1.435 | 950 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | |
| 3,192 % fällig am 25.09.2035 (e) | 641 | 515 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 26 | 27 | 0,00 |
| **SACO I, Inc.** | | | |
| 0,822 % fällig am 25.04.2035 | 12 | 10 | 0,00 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust (e)** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 | 106 | 42 | 0,00 |
| 0,552 % fällig am 25.05.2037 | 326 | 222 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 0,752 % fällig am 20.07.2033 | 734 | 695 | 0,01 |
| 1,102 % fällig am 19.10.2026 | 169 | 166 | 0,00 |
| 2,387 % fällig am 20.01.2047 (e) | 1.125 | 920 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 20.04.2035 | 323 | 335 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,642 % fällig am 25.05.2037 | 34 | 28 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.10.2035 | 1.457 | 1.214 | 0,02 |
| 0,902 % fällig am 25.06.2035 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,540 % fällig am 25.09.2034 | 53 | 53 | 0,00 |
| 2,580 % fällig am 25.04.2034 | 866 | 868 | 0,01 |
| 2,586 % fällig am 25.08.2035 | 215 | 201 | 0,00 |
| 2,586 % fällig am 25.02.2034 | 348 | 349 | 0,01 |
| 2,632 % fällig am 25.09.2034 | 1.249 | 1.246 | 0,02 |
| 2,718 % fällig am 25.11.2035 (e) | 344 | 274 | 0,00 |
| 2,719 % fällig am 25.07.2035 (e) | 3.864 | 3.333 | 0,04 |
| 2,737 % fällig am 25.09.2034 | 1.191 | 1.189 | 0,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 | 6.112 | 4.650 | 0,06 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2036 | 305 | 255 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | 1.729 | 1.364 | 0,02 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2036 | 7.171 | 5.391 | 0,07 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2046 | 4.499 | 2.511 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.09.2047 | 80 | 64 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | 204 | 199 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2046 (e) | 155 | 62 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2036 (e) | 1.262 | 985 | 0,01 |
| 0,982 % fällig am 19.07.2034 | 123 | 123 | 0,00 |
| 1,102 % fällig am 19.03.2034 | $ 24 | $ 24 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.12.2035 (e) | 326 | 226 | 0,00 |
| 1,757 % fällig am 25.08.2047 (e) | 3.205 | 2.673 | 0,03 |
| 2,609 % fällig am 25.05.2047 (e) | 6.204 | 4.383 | 0,06 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 1,062 % fällig am 19.09.2032 | 147 | 143 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2035 | 49 | 47 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 5,480 % fällig am 25.07.2034 | 4.793 | 5.048 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2034 | 591 | 604 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | 3.201 | 3.290 | 0,04 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,630 % fällig am 25.01.2037 (e) | 52 | 34 | 0,00 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | |
| 1,107 % fällig am 25.08.2037 (e) | 294 | 98 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,672 % fällig am 25.06.2037 (e) | 5.080 | 4.468 | 0,06 |
| 2,084 % fällig am 25.06.2047 (e) | 4.573 | 4.099 | 0,05 |
| 2,394 % fällig am 25.06.2037 | 4.782 | 4.588 | 0,06 |
| 2,444 % fällig am 25.03.2037 | 2.738 | 2.427 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 25.06.2037 | 7.564 | 7.453 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 25.06.2047 | 190 | 182 | 0,00 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust (f)** | | | |
| 1,086 % fällig am 10.03.2046 | 101.819 | 5.733 | 0,07 |
| 1,816 % fällig am 10.12.2045 | 99.511 | 8.563 | 0,11 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.12.2045 | 75 | 72 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2045 | 856 | 811 | 0,01 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | 374 | 347 | 0,01 |
| 0,732 % fällig am 25.01.2045 | 861 | 817 | 0,01 |
| 0,832 % fällig am 25.11.2045 | 955 | 850 | 0,01 |
| 0,832 % fällig am 25.12.2045 | 763 | 679 | 0,01 |
| 1,053 % fällig am 25.12.2046 | 75 | 69 | 0,00 |
| 1,062 % fällig am 25.01.2045 | 195 | 185 | 0,00 |
| 1,162 % fällig am 25.11.2034 | 691 | 660 | 0,01 |
| 1,237 % fällig am 25.06.2046 | 2.244 | 2.107 | 0,03 |
| 1,257 % fällig am 25.02.2046 | 7.121 | 6.570 | 0,08 |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | 118 | 111 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 25.08.2042 | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,899 % fällig am 27.02.2034 | 347 | 340 | 0,01 |
| 1,901 % fällig am 25.01.2047 | 1.081 | 981 | 0,01 |
| 2,151 % fällig am 25.10.2046 | 32 | 29 | 0,00 |
| 2,155 % fällig am 25.05.2037 (e) | 3.496 | 2.885 | 0,04 |
| 2,183 % fällig am 25.03.2033 | 36 | 36 | 0,00 |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 (e) | 1.449 | 1.295 | 0,02 |
| 2,337 % fällig am 25.03.2036 | 270 | 258 | 0,00 |
| 2,408 % fällig am 25.09.2036 (e) | 2.584 | 2.349 | 0,03 |
| 2,439 % fällig am 25.03.2034 | 26 | 26 | 0,00 |
| 2,515 % fällig am 25.08.2034 | 348 | 348 | 0,01 |
| 2,559 % fällig am 25.06.2033 | 220 | 223 | 0,00 |
| 2,563 % fällig am 25.09.2033 | 107 | 107 | 0,00 |
| 2,568 % fällig am 25.12.2035 | 1.187 | 1.132 | 0,02 |
| 2,580 % fällig am 25.08.2035 | 305 | 291 | 0,00 |
| 3,683 % fällig am 25.03.2036 | 3.226 | 2.926 | 0,04 |
| 4,432 % fällig am 25.05.2037 (e) | 6.879 | 6.101 | 0,08 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.10.2036 | 77 | 40 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,439 % fällig am 25.05.2041 | 12 | 12 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (e)** | | | |
| 0,672 % fällig am 25.07.2046 | 73 | 33 | 0,00 |
| 1,197 % fällig am 25.07.2046 | 959 | 612 | 0,01 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,477 % fällig am 25.06.2033 | 24 | 24 | 0,00 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 2,061 % fällig am 15.10.2045 (f) | 23.698 | 2.081 | 0,03 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,658 % fällig am 25.03.2035 | 431 | 434 | 0,01 |
| 2,735 % fällig am 25.10.2035 | 1.590 | 1.601 | 0,02 |
| 2,736 % fällig am 25.04.2036 | 440 | 439 | 0,01 |
| 2,738 % fällig am 25.07.2036 (e) | 349 | 340 | 0,01 |
| 2,755 % fällig am 25.06.2035 | 404 | 402 | 0,01 |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 | 410 | 408 | 0,01 |
| 2,786 % fällig am 25.12.2033 | $ 10 | $ 10 | 0,00 |
| 2,803 % fällig am 25.03.2036 | 995 | 987 | 0,01 |
| 2,829 % fällig am 25.03.2036 | 332 | 320 | 0,00 |
| 5,788 % fällig am 25.04.2036 (e) | 285 | 49 | 0,00 |
| | | 515.907 | 6,57 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Clark County, Nevada, Build America Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 6,881 % fällig am 01.07.2042 | 50 | 56 | 0,00 |
| **Cook County, Illinois, Transit Authority Revenue Bonds, Series 2008** | | | |
| 6,899 % fällig am 01.12.2040 | 6.800 | 7.910 | 0,10 |
| **Dane, Wisconsin, General Revenue Bonds, Series 2003** | | | |
| 5,700 % fällig am 01.05.2026 | 50 | 58 | 0,00 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,834 % fällig am 15.02.2041 | 800 | 1.102 | 0,01 |
| **King, Washington, Port of Seattle, Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2036 | 100 | 113 | 0,00 |
| **King, Washington, State Convention Center Public Facilities District Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,790 % fällig am 01.07.2040 | 1.000 | 1.225 | 0,02 |
| **Los Angeles, California, Los Angeles County Public Works Financing Authority Lease Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,488 % fällig am 01.08.2033 | 400 | 540 | 0,01 |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | 2.600 | 3.641 | 0,05 |
| **Marion, Oregon, General Obligation Bonds, Series 2003** | | | |
| 5,762 % fällig am 01.06.2023 | 50 | 57 | 0,00 |
| 5,892 % fällig am 01.06.2027 | 50 | 60 | 0,00 |
| **Middlesex, New Jersey, Turnpike Authority Revenue Bonds, Series 2003** | | | |
| 4,252 % fällig am 01.01.2016 | 10 | 10 | 0,00 |
| **New York, New York, Metropolitan Transportation Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,814 % fällig am 15.11.2040 | 2.500 | 3.314 | 0,04 |
| **Polk County, Iowa, Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | 1.175 | 1.181 | 0,01 |
| **Riverside, California, Electric Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,455 % fällig am 01.10.2030 | 1.000 | 1.298 | 0,02 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,700 % fällig am 01.11.2030 | 7.610 | 9.257 | 0,12 |
| 7,950 % fällig am 01.03.2036 | 2.100 | 2.514 | 0,03 |
| **Salt Lake, Utah, Build America General Obligation Bonds, Series 2009** | | | |
| 4,554 % fällig am 01.07.2024 | 15 | 17 | 0,00 |
| **San Diego, California, Community College District General Obligation Bonds, (FSA Insured), Series 2010** | | | |
| 7,194 % fällig am 01.08.2045 | 300 | 351 | 0,00 |
| **San Diego, California, County Regional Airport Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,628 % fällig am 01.07.2040 | 500 | 570 | 0,01 |
| | | 33.274 | 0,42 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Navient Corp. (a)** | | | |
| 1,964 % fällig am 15.03.2017 | 13.200 | 312 | 0,01 |
| 2,221 % fällig am 16.01.2018 | 11.700 | 271 | 0,00 |
| | | 583 | 0,01 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,281 % fällig am 25.12.2036 | $ 1.043 | 1.042 | 0,01 |
| 0,542 % fällig am 25.03.2034 | 420 | 418 | 0,01 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2034 | 120 | 119 | 0,00 |
| 0,626 % fällig am 25.08.2022 (f) | 93.363 | 2.924 | 0,04 |
| 0,768 % fällig am 25.05.2022 (f) | 147.082 | 5.604 | 0,07 |
| 0,772 % fällig am 25.09.2042 - 25.03.2044 | 144 | 144 | 0,00 |
| 0,822 % fällig am 25.06.2029 - 25.09.2032 | 8 | 8 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 0,852 % fällig am 25.11.2040 | $ 6.734 | $ 6.760 | 0,09 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2040 | 11.302 | 11.364 | 0,15 |
| 0,922 % fällig am 25.11.2040 - 25.12.2040 | 13.386 | 13.426 | 0,17 |
| 1,072 % fällig am 25.09.2023 | 28 | 28 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 01.07.2044 - 01.10.2044 | 205 | 210 | 0,00 |
| 1,831 % fällig am 01.01.2033 | 112 | 117 | 0,00 |
| 2,022 % fällig am 01.10.2034 | 52 | 55 | 0,00 |
| 2,030 % fällig am 01.04.2033 | 121 | 127 | 0,00 |
| 2,031 % fällig am 01.04.2033 | 198 | 207 | 0,00 |
| 2,224 % fällig am 01.10.2034 | 79 | 83 | 0,00 |
| 2,255 % fällig am 01.12.2034 | 255 | 265 | 0,00 |
| 2,326 % fällig am 25.05.2035 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,333 % fällig am 25.01.2022 (f) | 36.472 | 3.482 | 0,05 |
| 2,336 % fällig am 01.08.2033 | 81 | 86 | 0,00 |
| 2,373 % fällig am 01.06.2035 | 78 | 82 | 0,00 |
| 2,498 % fällig am 01.09.2037 | 239 | 253 | 0,00 |
| 2,545 % fällig am 01.08.2035 | 295 | 309 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 01.11.2034 | 1.744 | 1.845 | 0,02 |
| 2,633 % fällig am 01.06.2030 | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,836 % fällig am 01.12.2030 | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2027 | 137 | 142 | 0,00 |
| 3,490 % fällig am 01.12.2020 | 91.696 | 96.228 | 1,23 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2026 | 58 | 61 | 0,00 |
| 3,889 % fällig am 25.02.2018 (f) | 13.758 | 808 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2020 - 01.02.2026 | 1.043 | 1.072 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.05.2027 | 283 | 306 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2020 - 01.03.2022 | 17 | 17 | 0,00 |
| 5,110 % fällig am 01.06.2018 | 2.461 | 2.516 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2023 - 01.11.2039 | 262 | 293 | 0,01 |
| 5,720 % fällig am 01.07.2018 | 5.263 | 5.430 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 1.938 | 2.186 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2036 - 01.08.2037 | 391 | 439 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 01.11.2036 | 90 | 96 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2030 | 185 | 274 | 0,00 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 171.000 | 170.885 | 2,18 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 - 01.02.2046 | 208.100 | 214.414 | 2,73 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 75.000 | 79.297 | 1,01 |
| 5,500 % fällig am 01.01.2046 | 3.000 | 3.345 | 0,04 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,571 % fällig am 15.05.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 0,781 % fällig am 15.12.2031 | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,811 % fällig am 15.10.2040 | 7.182 | 7.220 | 0,09 |
| 0,931 % fällig am 15.12.2037 | 703 | 706 | 0,01 |
| 2,447 % fällig am 01.10.2034 | $ 84 | $ 89 | 0,00 |
| 2,474 % fällig am 01.08.2035 | 268 | 281 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2033 | 121 | 129 | 0,00 |
| 2,521 % fällig am 01.09.2035 | 121 | 128 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045 | 1.557 | 1.558 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.09.2042 | 719 | 743 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041 | 73 | 77 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039 | 1.835 | 2.085 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039 | 205 | 227 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 6.163 | 7.000 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 01.10.2037 | 21 | 24 | 0,00 |
| **Freddie Mac TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | 74.000 | 73.884 | 0,94 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 - 01.02.2046 | 66.000 | 67.888 | 0,87 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,625 % fällig am 20.11.2026 - 20.12.2026 | 3 | 3 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030 | 42 | 43 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026 | 33 | 34 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.01.2025 - 20.05.2030 | 37 | 38 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2039 - 15.06.2039 | 184 | 201 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 20.04.2038 | 72 | 79 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039 | 821 | 914 | 0,01 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 - 15.02.2046 | 80.000 | 83.295 | 1,06 |
| 4,000 % fällig am 20.01.2046 - 01.02.2046 | 200.600 | 212.891 | 2,71 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,760 % fällig am 01.09.2025 | 54 | 57 | 0,00 |
| 4,840 % fällig am 01.05.2025 | 79 | 84 | 0,00 |
| 5,090 % fällig am 01.10.2025 | 71 | 77 | 0,00 |
| 5,902 % fällig am 10.02.2018 | 152 | 161 | 0,00 |
| 7,060 % fällig am 01.11.2019 | 17 | 18 | 0,00 |
| 7,220 % fällig am 01.11.2020 | 187 | 200 | 0,00 |
| **Tennessee Valley Authority** | | | |
| 5,500 % fällig am 18.07.2017 | 181 | 193 | 0,00 |
| | | 1.087.122 | 13,84 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 - 15.01.2023 (b)(g) | 242.803 | 234.566 | 2,99 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | $ 260.075 | $ 248.485 | 3,16 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 66.795 | 64.720 | 0,82 |
| 1,375 % fällig am 15.01.2020 - 15.02.2044 (g)(h) | 9.873 | 10.207 | 0,13 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 21.457 | 23.476 | 0,30 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 - 15.01.2027 | 9.273 | 10.711 | 0,14 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 15.176 | 18.007 | 0,23 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 (h) | 16.493 | 22.440 | 0,29 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 (g)(h) | 2.250 | 2.221 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 4.700 | 4.218 | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 15.11.2042 | 75.800 | 72.297 | 0,92 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | 8.855 | 8.602 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042 - 15.05.2045 | 10.900 | 10.877 | 0,14 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | 31.800 | 32.509 | 0,41 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2044 | 14.900 | 15.995 | 0,20 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | 1.800 | 2.025 | 0,03 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2040 | 5.500 | 6.922 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 | 1.300 | 1.694 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 15.02.2029 | 10.200 | 13.368 | 0,17 |
| 5,500 % fällig am 15.08.2028 | 650 | 865 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.11.2027 | 7.900 | 10.940 | 0,14 |
| **US Treasury Notes (g)** | | | |
| 1,750 % fällig am 15.05.2022 - 15.05.2023 (h) | 14.000 | 13.671 | 0,17 |
| 2,000 % fällig am 30.11.2020 - 15.02.2025 (h) | 58.500 | 58.610 | 0,75 |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 (h) | 13.000 | 13.138 | 0,17 |
| 2,625 % fällig am 15.08.2020 | 950 | 987 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 31.10.2016 | 750 | 765 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2017 | 912 | 956 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.08.2017 | 1.594 | 1.690 | 0,02 |
| **US Treasury Strips** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2026 | 34.600 | 26.702 | 0,34 |
| | | 931.664 | 11,86 |
| Summe USA | | 3.139.826 | 39,97 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 864.023 | 8.642 | 0,11 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 8.745.587 | 111,34 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 336 | $ (236) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 48 | (19) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 217 | (167) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 252 | (149) | 0,00 |
| 90-Day Sterling March Futures | Short | 03/2017 | 61 | (43) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 145 | 37 | 0,00 |
| Australia Government 3-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 125 | 27 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 259 | (522) | (0,01) |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 8.740 | (5.606) | (0,07) |
| Euro-Bono Spanish Government Bond March Futures | Short | 03/2016 | 293 | 958 | 0,01 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 1.173 | 691 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 5.401 | (868) | (0,01) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 57 | (165) | 0,00 |
| Euro-OAT March Futures | Long | 03/2016 | 1.067 | (2.310) | (0,03) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 4.919 | 1.326 | 0,02 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 498 | (289) | (0,01) |
| US Treasury 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 48 | (7) | 0,00 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 4.206 | $ (1.055) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 12.898 | (5.830) | (0,08) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 127 | (46) | 0,00 |
| | | | | $ (14.273) | (0,18) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | € 172,500 | 19.02.2016 | 4.898 | $ 56 | $ 53 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 3.888 | 34 | 31 | 0,00 |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 108,000 | 19.02.2016 | 12.920 | 111 | 202 | 0,00 |
| | | | | $ 201 | $ 286 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (13.987)** | **(0,18)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 138.699 | $ (4.210) | (0,05) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 146.900 | (339) | (0,01) |
| CDX.IG-22 Index | 1,000 % | 20.06.2019 | 6.400 | (45) | 0,00 |
| CDX.IG-23 Index | 1,000 % | 20.12.2019 | 13.000 | (52) | 0,00 |
| CDX.IG-24 Index | 1,000 % | 20.06.2020 | 18.800 | (208) | 0,00 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 305.000 | (882) | (0,01) |
| iTraxx Europe Senior Financials Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 472.100 | 737 | 0,01 |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 398.100 | (700) | (0,01) |
| | | | | $ (5.699) | (0,07) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,013 % | 23.01.2025 | SEK 83.500 | $ (313) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,023 % | 23.01.2025 | 68.300 | (248) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,033 % | 23.01.2025 | 79.100 | (287) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,036 % | 23.01.2025 | 80.700 | (281) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,080 % | 26.01.2025 | 37.000 | (111) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,085 % | 26.01.2025 | 43.900 | (129) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | $ 1.973.750 | (3.321) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,150 % | 15.06.2017 | 226.400 | (313) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | 219.100 | (620) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 31.08.2022 | 96.400 | (209) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 1.128.100 | (22.682) | (0,29) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 13.01.2023 | 139.800 | (2.362) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 765.300 | 2.611 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 16.12.2035 | 77.300 | 4.745 | 0,06 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 15.06.2046 | 23.000 | (111) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,500 % | 17.12.2025 | AUD 1.100 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.06.2026 | 17.700 | 32 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 189.100 | 709 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,493 % | 16.03.2021 | 29.800 | 190 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 687.900 | (117) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,564 % | 30.11.2045 | 56.500 | 641 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 76.850 | 307 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 141.200 | (545) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.09.2018 | 270.300 | (2.901) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 65.800 | (69) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 20.400 | (590) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 19.450 | (301) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 22.03.2018 | JPY 143.110.000 | 501 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 % | 17.09.2021 | 43.130.000 | (4.059) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 18.12.2025 | 27.190.000 | 2.073 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 19.06.2033 | 3.000 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,250 % | 17.06.2035 | 4.410.000 | 1.156 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2045 | 4.710.000 | 1.248 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,300 % | 01.09.2016 | MXN 2.961.800 | 1.012 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,340 % | 28.09.2017 | 1.067.900 | (103) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,195 % | 05.10.2017 | 811.600 | (57) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,130 % | 17.10.2017 | 2.433.900 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,260 % | 31.10.2017 | 1.848.600 | (127) | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | IBMEXID | 5,010 % | 10.10.2019 | MXN 1.407.400 | $ 507 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,615 % | 02.06.2020 | 1.846.500 | 573 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,560 % | 11.11.2021 | 49.500 | (29) | 0,00 |
| | | | | | $ (23.564) | (0,30) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (29.263)** | **(0,37)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | CBK | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 20.000 | $ 886 | $ 1.063 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 4,000 | 28.03.2016 | 9.600 | 432 | 510 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 32.800 | 1.444 | 1.742 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNY 6,520 | 31.10.2016 | 1.943 | 596 | 1.360 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 125,100 | 27.01.2016 | 47.600 | 338 | 13 | 0,00 |
| | | | | | $ 3.696 | $ 4.688 | 0,06 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 41.700 | $ (75) | $ (35) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 66.100 | (123) | (55) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 20.000 | (44) | (17) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | GST | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 96.500 | (58) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | GST | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 96.500 | (183) | (147) | 0,00 |
| | | | | | | $ (483) | $ (254) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | CBK | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 20.000 | $ (418) | $ (517) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 4,300 | 28.03.2016 | 9.600 | (202) | (248) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,300 | 28.03.2016 | 32.800 | (681) | (848) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,150 | 21.06.2016 | 56.000 | (1.921) | (13.907) | (0,18) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNY 6,600 | 05.02.2016 | 23.400 | (263) | (148) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 6,600 | 05.02.2016 | 19.810 | (226) | (125) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | AZD | 7,000 | 01.11.2016 | 13.500 | (156) | (216) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 7,000 | 01.11.2016 | 33.800 | (404) | (540) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | MSB | RUB 70,000 | 02.02.2016 | 11.400 | (201) | (603) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | CBK | 71,500 | 09.03.2016 | 8.800 | (189) | (469) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | CBK | BRL 3,800 | 28.03.2016 | 20.000 | (389) | (307) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,800 | 28.03.2016 | 9.600 | (193) | (147) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 32.800 | (693) | (503) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 117,350 | 27.01.2016 | 93.900 | (671) | (173) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.082,500 | 19.01.2016 | 18.900 | (143) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | GLM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 10.200 | (78) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 16.600 | (128) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (6.956) | $ (18.751) | (0,24) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 0,400 % | 29.04.2016 | € 109.300 | $ (402) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 109.300 | (955) | (2.332) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 55.450 | (966) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 55.450 | (882) | (9) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 73.750 | (582) | (236) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 73.750 | (397) | (462) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 88.700 | (656) | (94) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 01.02.2016 | 88.700 | (595) | (75) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (5.435) | $ (3.208) | (0,04) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 217,965 | Maximal [1-(Final Index/Initial Index), 0] | 29.09.2020 | $ 10.700 | $ (138) | $ (7) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Agrium, Inc. | (1,250 %) | 20.03.2019 | BOA | $ 4.000 | $ (90) | $ 0 | $ (90) | 0,00 |
| Burlington Northern Santa Fe LLC | (0,510 %) | 20.03.2018 | RYL | 149 | (2) | (2) | 0 | 0,00 |
| Cleveland Electric Illuminating Co. | (0,940 %) | 20.06.2017 | RYL | 74 | (1) | (2) | 1 | 0,00 |
| Springleaf Finance Corp. | (5,000 %) | 20.06.2020 | BRC | 3.700 | (259) | (275) | 16 | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | BPS | 4.800 | (6) | 1 | (7) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | BRC | 14.200 | (18) | 9 | (27) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | CBK | 9.600 | (12) | 9 | (21) | 0,00 |
| | | | | | $ (388) | $ (260) | $ (128) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | BOA | $ 8.000 | $ (928) | $ (228) | $ (700) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 11.700 | (1.129) | (501) | (628) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | DUB | 16.500 | (1.913) | (485) | (1.428) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 1.200 | (128) | (23) | (105) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 13.000 | (1.254) | (617) | (637) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 20.900 | (2.016) | (930) | (1.086) | (0,03) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 5.900 | (684) | (168) | (516) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | GST | 500 | (303) | (49) | (254) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2019 | GST | 300 | (202) | (44) | (158) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 400 | (280) | (73) | (207) | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BOA | 21.400 | 51 | (165) | 216 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BRC | 17.700 | 42 | (115) | 157 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | CBK | 14.400 | 34 | (129) | 163 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | CBK | 3.200 | 6 | (19) | 25 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | GST | 78.200 | 184 | (702) | 886 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | GST | 7.400 | 13 | (41) | 54 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | HUS | 8.400 | 20 | (53) | 73 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | JPM | 27.800 | 65 | (214) | 279 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | JPM | 6.400 | 11 | (36) | 47 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | MYC | 18.900 | 45 | (130) | 175 | 0,00 |
| Greece Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 600 | (23) | (168) | 145 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 16.000 | (63) | (212) | 149 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 15.200 | (60) | (178) | 118 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | € 11.000 | (673) | (163) | (510) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 5.500 | (514) | (455) | (59) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 3.800 | (355) | (320) | (35) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | FBF | 3.200 | (299) | (252) | (47) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 6.100 | (374) | (78) | (296) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | MYC | 5.300 | (325) | (102) | (223) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 3.800 | (355) | (301) | (54) | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 4.900 | (7) | (41) | 34 | 0,00 |
| | | | | | $ (11.414) | $ (6.992) | $ (4.422) | (0,15) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | BRC | € 14.500 | $ 415 | $ 311 | $ 104 | 0,01 |
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | SOG | 6.600 | 189 | 154 | 35 | 0,00 |
| | | | | | $ 604 | $ 465 | $ 139 | 0,01 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BOA | € 242.200 | $ 265.693 | $ 2.312 | $ (799) | $ 3.111 | 0,03 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | BOA | 25.700 | 27.859 | 434 | 80 | 354 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | BOA | 28.700 | 30.566 | 260 | (138) | 398 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.12.2020 | BPS | 139.800 | 151.543 | 1.870 | 175 | 1.695 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BPS | 127.100 | 139.429 | 1.538 | (95) | 1.633 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | CBK | 127.000 | 139.319 | 1.212 | (419) | 1.631 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | CBK | 148.400 | 160.866 | 3.863 | 1.818 | 2.045 | 0,05 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | DUB | 274.600 | 301.236 | 3.322 | (206) | 3.528 | 0,04 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | DUB | 17.000 | 18.037 | 222 | (13) | 235 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month JPY-LIBOR abzgl. 0,483 % basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 10.02.2016 | JPM | $ 168.902 | JPY 3.850.000 | 53.888 | (42) | 53.930 | 0,69 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month JPY-LIBOR abzgl. 0,908 % basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | MYC | 30.631 | 3.740.000 | (185) | (283) | 98 | 0,00 |
| | | | | | | $ 68.736 | $ 78 | $ 68.658 | 0,88 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | JPM | BRL 192.700 | $ (337) | $ (28) | $ (309) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | DUB | 48.400 | (1.435) | (1) | (1.434) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | HUS | 20.000 | (593) | (4) | (589) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BPS | 102.200 | (2.848) | 95 | (2.943) | (0,04) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,700 % | 04.01.2021 | HUS | 4.800 | 84 | 61 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | GLM | 160.300 | 300 | 86 | 214 | 0,01 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | MYC | 99.600 | 186 | 86 | 100 | 0,00 |
| | | | | | | $ (4.643) | $ 295 | $ (4.938) | (0,06) |

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 16.08.2016 | DUB | CHF 201 | $ 337 | $ 0 | $ 337 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,085 % | 16.08.2016 | DUB | 90 | 160 | 0 | 160 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,087 % | 16.08.2016 | DUB | 204 | 404 | 0 | 404 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,088 % | 16.08.2016 | DUB | 83 | 173 | 0 | 173 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,090 % | 16.08.2016 | DUB | 97 | 224 | 0 | 224 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 06.12.2016 | DUB | 54 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,103 % | 16.08.2016 | DUB | (99) | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,105 % | 16.08.2016 | DUB | (90) | (8) | (1) | (7) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,106 % | 16.08.2016 | DUB | (201) | (41) | 0 | (41) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,109 % | 16.08.2016 | DUB | (105) | (93) | 0 | (93) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,112 % | 16.08.2016 | DUB | (180) | (198) | 0 | (198) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,108 % | 06.12.2016 | DUB | (54) | (23) | 0 | (23) | 0,00 |
| | | | | | | $ 996 | $ (1) | $ 997 | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 6.985 | AUD | 9.608 | BOA | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 213.041 | | 293.149 | CBK | 240 | 0 | 240 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 302.757 | $ | 218.590 | GLM | 0 | (1.680) | (1.680) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 251.396 | | 80.170 | BOA | 16.652 | (26) | 16.626 | 0,21 |
| 01/2016 | $ | 64.381 | BRL | 251.396 | BOA | 0 | (837) | (837) | (0,01) |
| 01/2016 | | 41.546 | | 162.227 | BPS | 0 | (540) | (540) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 162.227 | $ | 41.153 | BPS | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| 01/2016 | | 129.704 | | 33.217 | CBK | 432 | 0 | 432 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 34.139 | BRL | 129.704 | CBK | 0 | (1.355) | (1.355) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 128.668 | $ | 32.886 | DUB | 364 | 0 | 364 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 32.951 | BRL | 128.668 | DUB | 0 | (429) | (429) | (0,01) |
| 01/2016 | | 18.248 | | 70.725 | FBF | 0 | (371) | (371) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 70.725 | $ | 18.112 | FBF | 236 | 0 | 236 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 96 | BRL | 376 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 376 | $ | 97 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 216.233 | | 67.509 | JPM | 12.853 | 0 | 12.853 | 0,16 |
| 01/2016 | $ | 55.945 | BRL | 216.233 | JPM | 0 | (1.289) | (1.289) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 327.173 | $ | 83.787 | MSB | 1.090 | 0 | 1.090 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 83.929 | BRL | 327.173 | MSB | 0 | (1.231) | (1.231) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 36.535 | $ | 9.462 | UAG | 228 | 0 | 228 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.356 | BRL | 36.535 | UAG | 0 | (122) | (122) | 0,00 |
| 01/2016 | | 236.029 | CAD | 327.698 | BOA | 0 | (122) | (122) | 0,00 |
| 01/2016 | | 204 | | 280 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.056 | | 1.408 | HUS | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 329.008 | $ | 247.159 | MSB | 10.309 | 0 | 10.309 | 0,13 |
| 01/2016 | | 378 | | 279 | SCX | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 1.291 | | 1.258 | CBK | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| 01/2016 | | 722 | | 736 | TOR | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 61.827 | | 9.560 | BRC | 187 | 0 | 187 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.732 | CNH | 36.532 | CBK | 0 | (194) | (194) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 116.192 | $ | 17.697 | JPM | 783 | 0 | 783 | 0,01 |
| 01/2016 | | 140.360 | | 21.480 | MSB | 1.048 | 0 | 1.048 | 0,01 |
| 01/2016 | € | 54 | | 59 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50.729 | | 54.631 | CBK | 134 | (610) | (476) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 175.635 | € | 163.806 | CBK | 2.343 | (35) | 2.308 | 0,03 |
| 01/2016 | € | 96.264 | $ | 102.927 | GLM | 153 | (1.797) | (1.644) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 35.053 | € | 32.301 | GLM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.709.807 | | 1.555.863 | HUS | 0 | (19.673) | (19.673) | (0,25) |
| 01/2016 | | 84.089 | | 77.086 | JPM | 91 | (441) | (350) | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.770 | | 6.249 | MSB | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 181 | $ | 197 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 31.928 | € | 29.443 | UAG | 280 | (224) | 56 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.717.768 | $ | 1.826.248 | UAG | 1 | (39.765) | (39.764) | (0,51) |
| 01/2016 | £ | 2 | | 3 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 155 | | 232 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 30.174 | £ | 20.054 | BOA | 0 | (616) | (616) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 14.883 | $ | 22.446 | BOA | 510 | 0 | 510 | 0,01 |
| 01/2016 | | 111 | | 163 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.129 | £ | 756 | BPS | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 141.078 | $ | 212.311 | BPS | 4.376 | 0 | 4.376 | 0,06 |
| 01/2016 | | 106 | | 158 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | | 5 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.147 | £ | 768 | DUB | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 238.161 | $ | 358.277 | HUS | 7.251 | 0 | 7.251 | 0,09 |
| 01/2016 | | 15.599 | | 23.466 | JPM | 474 | 0 | 474 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 4.272 | £ | 2.833 | JPM | 0 | (96) | (96) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 27 | $ | 40 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 563.494 | £ | 380.745 | SCX | 0 | (2.313) | (2.313) | (0,03) |
| 01/2016 | | 6.870 | | 4.565 | UAG | 0 | (141) | (141) | 0,00 |
| 01/2016 | IDR | 29.218.240 | $ | 2.096 | BRC | 0 | (10) | (10) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | IDR | 174.263.400 | $ | 12.492 | SOG | $ 0 | $ (70) | $ (70) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 102.524 | INR | 6.825.291 | BOA | 395 | (30) | 365 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 1.186.963 | $ | 17.889 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 80.093 | INR | 5.330.817 | JPM | 389 | (123) | 266 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 3.233.581 | $ | 48.655 | SCX | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.305.423 | | 19.652 | SOG | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 17.715.000 | | 144.221 | BOA | 0 | (3.054) | (3.054) | (0,04) |
| 01/2016 | | 1.630.000 | | 13.399 | BPS | 0 | (156) | (156) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 28.104 | JPY | 3.438.500 | GLM | 480 | 0 | 480 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 35.369.931 | $ | 289.561 | GLM | 0 | (4.465) | (4.465) | (0,06) |
| 01/2016 | | 40.109.948 | | 326.637 | JPM | 0 | (6.819) | (6.819) | (0,09) |
| 01/2016 | $ | 263.889 | JPY | 31.931.431 | MSB | 1.554 | 0 | 1.554 | 0,02 |
| 01/2016 | | 13.268 | KRW | 15.661.933 | BPS | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 9.820.807 | $ | 8.564 | CBK | 211 | 0 | 211 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.064 | KRW | 4.712.208 | CBK | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 306.650 | $ | 267 | DUB | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50.386.253 | | 43.355 | FBF | 501 | 0 | 501 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.550 | KRW | 2.887.799 | GLM | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.150 | | 4.697.800 | JPM | 0 | (155) | (155) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 9.267.705 | $ | 7.975 | JPM | 93 | 0 | 93 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 20.556 | KRW | 23.917.187 | JPM | 68 | (282) | (214) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 3.440 | $ | 3 | RYL | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.187.993 | | 15.754 | SOG | 285 | 0 | 285 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.531 | KRW | 13.245.056 | UAG | 0 | (266) | (266) | 0,00 |
| 01/2016 | | 28.119 | MYR | 116.131 | AZD | 0 | (1.198) | (1.198) | (0,02) |
| 01/2016 | MYR | 134.020 | $ | 30.952 | BPS | 0 | (116) | (116) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.821 | | 421 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.168 | MYR | 17.514 | MSB | 0 | (108) | (108) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 253.719 | $ | 58.075 | SCX | 5 | (746) | (741) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 22.012 | MYR | 94.235 | SOG | 0 | (167) | (167) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 22.845 | $ | 5.405 | UAG | 109 | 0 | 109 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.148 | MYR | 17.372 | UAG | 0 | (121) | (121) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 182.539 | $ | 20.974 | HUS | 351 | 0 | 351 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 250 | NOK | 2.190 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 20.798 | | 180.349 | UAG | 0 | (423) | (423) | (0,01) |
| 01/2016 | NZD | 146.807 | $ | 95.594 | CBK | 0 | (4.910) | (4.910) | (0,06) |
| 01/2016 | $ | 20.443 | NZD | 30.422 | UAG | 384 | 0 | 384 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 422.646 | $ | 6.267 | JPM | 507 | 0 | 507 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 6.253 | RUB | 442.524 | MSB | 0 | (222) | (222) | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 19.877 | $ | 302 | SOG | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 121.859 | | 14.617 | CBK | 163 | 0 | 163 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14.555 | SEK | 124.415 | UAG | 203 | 0 | 203 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 66.986 | $ | 22.522 | JPM | 0 | (326) | (326) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 293.149 | | 212.752 | CBK | 0 | (230) | (230) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.508 | BRL | 17.788 | BPS | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.390 | | 13.415 | CBK | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | | 31.573 | | 124.791 | DUB | 0 | (350) | (350) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.365 | | 36.535 | UAG | 0 | (224) | (224) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 325.103 | $ | 234.113 | BOA | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 20.115 | | 2.947 | CBK | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | | 513.075 | | 74.138 | HUS | 0 | (627) | (627) | (0,01) |
| 02/2016 | | 47.195 | | 6.715 | JPM | 0 | (163) | (163) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.044 | € | 1.870 | CBK | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.555.863 | $ | 1.711.019 | HUS | 19.687 | 0 | 19.687 | 0,25 |
| 02/2016 | | 52.462 | | 57.577 | JPM | 547 | 0 | 547 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 761 | £ | 500 | BOA | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.191 | | 1.475 | GLM | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | | 747 | | 500 | JPM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 380.745 | $ | 563.537 | SCX | 2.312 | 0 | 2.312 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 1.005 | £ | 679 | UAG | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 20.305 | $ | 2.621 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.132 | HKD | 32.015 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 67.229.385 | $ | 4.703 | JPM | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| 02/2016 | | 235.405.980 | | 16.308 | SCX | 0 | (454) | (454) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 331 | ILS | 1.285 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 1.057.423 | $ | 15.640 | BRC | 0 | (215) | (215) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.327 | JPY | 163.000 | CBK | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.637 | | 197.900 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 31.709.031 | $ | 262.212 | MSB | 0 | (1.549) | (1.549) | (0,02) |
| 02/2016 | NOK | 180.349 | | 20.793 | UAG | 424 | 0 | 424 | 0,01 |
| 02/2016 | NZD | 116.385 | | 79.558 | UAG | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.628 | SEK | 121.859 | CBK | 0 | (162) | (162) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 548.356 | $ | 63.293 | CBK | 0 | (1.823) | (1.823) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 6.393 | SEK | 54.585 | CBK | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.016 | | 17.445 | DUB | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 2.235 | $ | 263 | DUB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 73.635 | | 8.492 | JPM | 0 | (252) | (252) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.045 | | 124 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 19.760 | | 13.953 | NGF | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 02/2016 | | 28.368 | | 20.150 | SCX | 188 | 0 | 188 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 558.637 | | 15.539 | FBF | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 02/2016 | | 163.713 | | 4.552 | JPM | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 324.298 | | 9.768 | BRC | 0 | (59) | (59) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | TWD | 44.500 | $ | 1.344 | DUB | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 617.052 | | 18.886 | GLM | 188 | 0 | 188 | 0,00 |
| 02/2016 | | 174.834 | | 5.282 | SOG | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 03/2016 | JPY | 350.000 | | 2.859 | BOA | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| 03/2016 | | 4.490.000 | | 36.720 | BPS | 0 | (656) | (656) | (0,01) |
| 03/2016 | | 10.520.000 | | 86.577 | BPS | 0 | (1.019) | (1.019) | (0,01) |
| 03/2016 | | 670.000 | | 5.472 | CBK | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.040.000 | | 8.490 | FBF | 0 | (168) | (168) | 0,00 |
| 03/2016 | | 13.190.000 | | 109.094 | HUS | 0 | (734) | (734) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 373 | MXN | 6.418 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 03/2016 | | 19.639 | | 338.434 | BRC | 0 | (142) | (142) | 0,00 |
| 03/2016 | | 335 | | 5.728 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 1.581.917 | $ | 90.756 | JPM | 0 | (379) | (379) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 9.000 | | 2.600 | BRC | 395 | 0 | 395 | 0,00 |
| 04/2016 | | 133.428 | | 38.569 | FBF | 5.870 | 0 | 5.870 | 0,07 |
| 04/2016 | | 7.050 | | 2.105 | GLM | 377 | 0 | 377 | 0,00 |
| 04/2016 | | 115.503 | | 34.484 | HUS | 6.178 | 0 | 6.178 | 0,08 |
| 04/2016 | | 37.632 | | 10.875 | MSB | 1.653 | 0 | 1.653 | 0,02 |
| 04/2016 | CZK | 22.042 | € | 821 | CBK | 23 | (18) | 5 | 0,00 |
| 04/2016 | | 200.379 | $ | 8.356 | MSB | 271 | 0 | 271 | 0,00 |
| 04/2016 | DKK | 694.499 | | 102.734 | BOA | 1.372 | 0 | 1.372 | 0,02 |
| 04/2016 | | 222.927 | | 32.997 | HUS | 461 | 0 | 461 | 0,01 |
| 04/2016 | | 194.186 | | 28.812 | JPM | 471 | 0 | 471 | 0,01 |
| 04/2016 | RUB | 442.524 | | 6.104 | MSB | 212 | 0 | 212 | 0,00 |
| 05/2016 | PLN | 33.924 | | 8.383 | GLM | 0 | (189) | (189) | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 143.743 | | 9.716 | BOA | 662 | 0 | 662 | 0,01 |
| 07/2016 | DKK | 88.752 | | 13.403 | BOA | 403 | 0 | 403 | 0,01 |
| 07/2016 | | 187.098 | | 28.254 | BPS | 850 | 0 | 850 | 0,01 |
| 07/2016 | | 53.031 | | 7.990 | DUB | 223 | 0 | 223 | 0,00 |
| 07/2016 | | 305.859 | | 46.063 | JPM | 1.265 | 0 | 1.265 | 0,02 |
| 07/2016 | | 165.455 | | 24.918 | UAG | 684 | 0 | 684 | 0,01 |
| 09/2016 | CNH | 236.809 | | 35.829 | BPS | 739 | 0 | 739 | 0,01 |
| 09/2016 | | 77.697 | | 11.682 | BRC | 159 | 0 | 159 | 0,00 |
| 09/2016 | | 36.783 | | 5.530 | CBK | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| 09/2016 | | 36.769 | | 5.530 | HUS | 77 | 0 | 77 | 0,00 |
| 09/2016 | | 442.642 | | 66.965 | JPM | 1.377 | 0 | 1.377 | 0,02 |
| 09/2016 | $ | 23.191 | CNH | 151.249 | JPM | 0 | (760) | (760) | (0,01) |
| 09/2016 | CNH | 109.188 | $ | 16.519 | UAG | 340 | 0 | 340 | 0,00 |
| 09/2016 | $ | 115.778 | CNH | 755.509 | UAG | 0 | (3.830) | (3.830) | (0,05) |
| 09/2016 | CZK | 400.601 | $ | 16.727 | CBK | 438 | 0 | 438 | 0,01 |
| 09/2016 | | 141.466 | | 5.897 | HUS | 134 | 0 | 134 | 0,00 |
| 09/2016 | | 394.277 | | 16.613 | HUS | 581 | 0 | 581 | 0,01 |
| 09/2016 | | 194.039 | | 8.086 | JPM | 182 | 0 | 182 | 0,00 |
| 10/2016 | | 171.923 | € | 6.460 | DUB | 165 | (93) | 72 | 0,00 |
| 10/2016 | | 353.120 | $ | 14.888 | DUB | 478 | 0 | 478 | 0,01 |
| 10/2016 | DKK | 566.070 | | 86.409 | JPM | 3.160 | 0 | 3.160 | 0,04 |
| 07/2017 | BRL | 314.200 | | 108.266 | BOA | 41.773 | 0 | 41.773 | 0,53 |
| 07/2017 | | 100.000 | | 34.340 | BPS | 13.178 | 0 | 13.178 | 0,17 |
| | | | | | | $ 174.017 | $ (112.586) | $ 61.431 | 0,78 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 97.790** | **1,24** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (k)** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.11.2046 | $ | (1.000) | $ (966) | (0,01) |
| 4,500 % fällig am 01.01.2046 | | (272.000) | (293.768) | (3,74) |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | | (156.000) | (168.229) | (2,14) |
| | | | $ (462.963) | (5,89) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (462.963)** | **(5,89)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ | 52.400 | $ 52.443 | 0,67 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **$ 52.443** | **0,67** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 8.389.607** | **106,81** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 868 | $ 1.279 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 518 | 518 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 357 | 260 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 515 | 352 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 563.059 | $ 4.681 | 0,06 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 14.369 | 14.369 | 0,18 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 5 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 8 | 8 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 24 | 3 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 5.557 | 46 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 9 | 6 | 0,00 |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 5 | 1 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 4 | 6 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 156 | 156 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 3 | 2 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 20 | 14 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 8 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4.482 | 4.482 | 0,06 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 14 | 14 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 7 | 8 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 4 | 3 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 38 | 2 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4.317 | 4.317 | 0,06 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 209 | 152 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 49 | 6 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 314 | 226 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 7.383 | 8.020 | 0,10 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 237.152 | 1.971 | 0,03 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 274 | 404 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 102 | 102 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | $ 41.412 | 0,53 |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | $ (576.372) | (7,34) |
| **Nettovermögen** | | | $ 7.854.647 | 100,00 |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 134.455 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

(c) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(d) Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.

(e) Das Wertpapier ist in Verzug.

(f) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(g) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 83.354 und Barmittel in Höhe von USD 11.687 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(h) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 14.233 und Barmittel in Höhe von USD 5.253 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.740 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 57.600 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.

(k) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(l) Eingeschränkte Wertpapiere

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Ally Financial, Inc. | 2,500 % | 15.03.2017 | 10.03.2014 | $ 20.400 | $ 19.996 | 0,26 |

**(m) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 103.905 | $ 8.613.536 | $ 28.146 | $ 8.745.587 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 52.443 | 0 | 52.443 |
| Finanzderivate[3] | (13.987) | 68.527 | 0 | 54.540 |
| Leerverkäufe | 0 | (462.963) | 0 | (462.963) |
| **Summen** | **$ 89.918** | **$ 8.271.543** | **$ 28.146** | **$ 8.389.607** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 454.909 | $ 8.438.786 | $ 31.322 | $ 8.925.017 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 82.613 | 0 | 82.613 |
| Finanzderivate[3] | 10.288 | 196.978 | 0 | 207.266 |
| Leerverkäufe | 0 | (755.903) | 0 | (755.903) |
| **Summen** | **$ 465.197** | **$ 7.962.474** | **$ 31.322** | **$ 8.458.993** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(n) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Investor CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 152.751 | CHF 156.806 | BOA | $ 3.905 | $ (6) | $ 3.899 | 0,05 |
| 01/2016 | CHF 284 | $ 281 | BPS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 740 | CHF 753 | BPS | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 6.481 | $ 6.474 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 186.028 | 188.191 | CBK | 2.348 | 0 | 2.348 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 941 | CHF 938 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | 181.993 | 185.815 | DUB | 3.636 | 0 | 3.636 | 0,05 |
| 01/2016 | CHF 102 | $ 101 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 22 | CHF 23 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 185.185 | $ 187.494 | JPM | 2.494 | 0 | 2.494 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 182.053 | CHF 185.948 | JPM | 3.708 | 0 | 3.708 | 0,05 |
| 01/2016 | 1.125 | 1.114 | MSB | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 160.887 | $ 162.418 | MSB | 1.700 | (9) | 1.691 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 53 | CHF 53 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 139 | $ 141 | SOG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | 185.185 | 187.474 | UAG | 2.474 | 0 | 2.474 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 183.118 | CHF 185.956 | UAG | 2.653 | 0 | 2.653 | 0,03 |
| 02/2016 | 656 | 647 | BOA | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | 187.677 | 185.287 | CBK | 0 | (2.343) | (2.343) | (0,03) |
| 02/2016 | 187.724 | 185.185 | JPM | 0 | (2.493) | (2.493) | (0,03) |
| 02/2016 | 160.027 | 158.325 | MSB | 0 | (1.662) | (1.662) | (0,02) |
| 02/2016 | 187.691 | 185.185 | UAG | 0 | (2.460) | (2.460) | (0,03) |
| | | | | $ 22.932 | $ (9.001) | $ 13.931 | 0,18 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 413.161 | $ 453.799 | BOA | $ 5.106 | $ (124) | $ 4.982 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 432.692 | € 405.832 | BOA | 8.163 | 0 | 8.163 | 0,10 |
| 01/2016 | 708 | 656 | BPS | 7 | (2) | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | € 624 | $ 684 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.559 | 15.815 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 33.701 | € 30.755 | CBK | 9 | (301) | (292) | 0,00 |
| 01/2016 | € 5.275 | $ 5.711 | CBK | 19 | (38) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | 1.507 | 1.612 | DUB | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 339.647 | € 320.551 | GLM | 8.567 | 0 | 8.567 | 0,11 |
| 01/2016 | € 408.509 | $ 448.928 | HUS | 5.165 | 0 | 5.165 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 438.248 | € 411.240 | HUS | 8.482 | 0 | 8.482 | 0,11 |
| 01/2016 | € 323.197 | $ 353.179 | JPM | 2.090 | 0 | 2.090 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 80 | € 75 | NAB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | € 422 | $ 460 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 804 | € | 734 | SCX | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 425.372 | $ | 463.932 | UAG | 2.426 | (575) | 1.851 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 432.587 | € | 407.049 | UAG | 9.589 | 0 | 9.589 | 0,12 |
| 02/2016 | | 449.188 | | 408.509 | BOA | 0 | (5.110) | (5.110) | (0,07) |
| 02/2016 | € | 3.792 | $ | 4.166 | BOA | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 449.246 | € | 408.509 | HUS | 0 | (5.169) | (5.169) | (0,07) |
| 02/2016 | | 353.421 | | 323.197 | JPM | 0 | (2.083) | (2.083) | (0,03) |
| 02/2016 | € | 7 | $ | 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 440.943 | € | 403.399 | UAG | 0 | (2.420) | (2.420) | (0,03) |
| | | | | | | $ 49.677 | $ (15.855) | $ 33.822 | 0,43 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Currency Exposure) Class, Institutional USD (Currency Exposure) Class, Investor USD (Currency Exposure) Class, Class E USD (Currency Exposure), Class R USD (Currency Exposure) und Class Z USD (Currency Exposure) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 12.062 | $ | 8.651 | AZD | $ 0 | $ (125) | $ (125) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.678 | AUD | 12.062 | NAB | 98 | 0 | 98 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 20.504 | $ | 14.763 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 15.387 | CAD | 20.504 | JPM | 0 | (627) | (627) | (0,01) |
| 01/2016 | CHF | 4.421 | $ | 4.472 | CBK | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.319 | CHF | 4.421 | FBF | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 13.996 | $ | 2.049 | BOA | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.988 | DKK | 13.996 | SCX | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 19 | $ | 20 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7 | € | 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.738 | $ | 1.904 | BPS | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.192 | | 3.466 | CBK | 12 | (13) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 786 | € | 725 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 7.459 | $ | 7.977 | DUB | 0 | (126) | (126) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 146.886 | € | 137.833 | HUS | 2.843 | 0 | 2.843 | 0,04 |
| 01/2016 | | 115 | | 108 | NAB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 39 | $ | 43 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.376 | | 1.507 | SCX | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | | 124.880 | | 136.361 | UAG | 741 | (37) | 704 | 0,01 |
| 01/2016 | £ | 238 | | 358 | AZD | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | | 120 | | 181 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 217 | £ | 145 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 232 | $ | 352 | BPS | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.223 | | 34.466 | CBK | 238 | 0 | 238 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 2 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 238 | | 361 | JPM | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 38.766 | £ | 25.713 | MSB | 0 | (868) | (868) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 6 | $ | 9 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.805 | | 2.741 | UAG | 81 | 0 | 81 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 493.335 | | 4.031 | BOA | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4 | JPY | 474 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 1.187 | $ | 10 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | JPY | 296 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 10.291 | $ | 85 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 927 | | 8 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 98.114 | JPY | 11.984.672 | GLM | 1.513 | 0 | 1.513 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY | ).795.088 | $ | 89.217 | MSB | 0 | (521) | (521) | (0,01) |
| 01/2016 | | 3.059 | | 25 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 470 | JPY | 57.627 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 741.767 | $ | 6.052 | UAG | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.064 | KRW | 9.484.336 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.238 | MYR | 5.435 | SCX | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 01/2016 | | 660 | NOK | 5.714 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.105 | NZD | 1.660 | BOA | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 22.698 | $ | 2.723 | CBK | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.610 | SEK | 22.698 | CBK | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.639 | AUD | 12.062 | AZD | 125 | 0 | 125 | 0,00 |
| 02/2016 | | 14.765 | CAD | 20.504 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.478 | CHF | 4.421 | CBK | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.050 | DKK | 13.996 | BOA | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 9 | $ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 134.947 | € | 123.456 | UAG | 0 | (741) | (741) | (0,01) |
| 02/2016 | | 34.357 | £ | 23.150 | CBK | 0 | (233) | (233) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 2 | $ | 3 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 842 | ILS | 3.266 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 730 | $ | 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 10 | | 0 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 89.268 | JPY | 10.795.088 | MSB | 527 | 0 | 527 | 0,01 |
| 02/2016 | | 2.725 | SEK | 22.698 | CBK | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.063 | SGD | 1.496 | SCX | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 15.039 | $ | 463 | BPS | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 2.197 | MXN | 37.680 | GLM | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 05/2016 | | 381 | HUF | 111.777 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 05/2016 | | 618 | PLN | 2.461 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 05/2016 | | 1.071 | ZAR | 15.929 | SCX | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | | | | | | $ 6.649 | $ (3.701) | $ 2.948 | 0,04 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged), Class R GBP (Hedged) und Class S GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 1.164 | $ 1.749 | AZD | $ 33 | $ 0 | $ 33 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 6.122 | £ 4.075 | BOA | 0 | (116) | (116) | 0,00 |
| 01/2016 | 157.803 | 104.854 | BPS | 0 | (3.260) | (3.260) | (0,04) |
| 01/2016 | £ 3.108 | $ 4.581 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 127.226 | 188.807 | CBK | 1.290 | 0 | 1.290 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 190.270 | £ 125.946 | CBK | 0 | (4.639) | (4.639) | (0,06) |
| 01/2016 | 187.365 | 124.289 | DUB | 0 | (4.176) | (4.176) | (0,05) |
| 01/2016 | 971 | 640 | JPM | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 125.395 | $ 186.083 | JPM | 1.263 | 0 | 1.263 | 0,01 |
| 01/2016 | 125.395 | 185.646 | MSB | 826 | 0 | 826 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 187.019 | £ 124.047 | MSB | 0 | (4.186) | (4.186) | (0,05) |
| 01/2016 | 57 | 39 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 106.881 | $ 158.182 | SCX | 649 | 0 | 649 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 680 | £ 453 | UAG | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 02/2016 | 186.037 | 125.354 | CBK | 0 | (1.263) | (1.263) | (0,02) |
| 02/2016 | 186.091 | 125.395 | JPM | 0 | (1.256) | (1.256) | (0,02) |
| 02/2016 | 185.658 | 125.395 | MSB | 0 | (823) | (823) | (0,01) |
| 02/2016 | 158.194 | 106.881 | SCX | 0 | (649) | (649) | (0,01) |
| 02/2016 | 1.196 | 802 | UAG | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | | | | $ 4.061 | $ (20.421) | $ (16.360) | (0,21) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | ILS 8 | $ 2 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 140 | ILS 544 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 1 | 4 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS 12 | $ 3 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 140 | ILS 543 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS 31 | $ 8 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 30 | 8 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 127 | ILS 491 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 140 | 544 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class und Investor NOK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 0 | NOK 3 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 425.605 | $ 48.695 | BOA | 612 | 0 | 612 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 49.168 | NOK 426.581 | BPS | 0 | (974) | (974) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 11.100 | $ 1.254 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 598 | NOK 5.174 | CBK | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 370 | $ 42 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 2.169 | 250 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 40.921 | NOK 356.144 | HUS | 0 | (685) | (685) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 425.930 | $ 49.128 | JPM | 1.007 | 0 | 1.007 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 49.240 | NOK 426.536 | JPM | 0 | (1.051) | (1.051) | (0,02) |
| 01/2016 | 11 | 93 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 6 | 53 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 364.122 | $ 41.720 | SCX | 583 | 0 | 583 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 49.386 | NOK 429.492 | SCX | 0 | (863) | (863) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 426.061 | $ 49.135 | UAG | 999 | 0 | 999 | 0,01 |
| 02/2016 | $ 48.684 | NOK 425.605 | BOA | 0 | (614) | (614) | (0,01) |
| 02/2016 | 49.115 | 425.930 | JPM | 0 | (1.009) | (1.009) | (0,01) |
| 02/2016 | 346 | 3.012 | MSB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | 41.707 | 364.100 | SCX | 0 | (584) | (584) | (0,01) |
| 02/2016 | 49.107 | 425.930 | UAG | 0 | (1.001) | (1.001) | (0,01) |
| | | | | $ 3.206 | $ (6.800) | $ (3.594) | (0,05) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NZD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | NZD 132.288 | $ 90.720 | AZD | $ 156 | $ 0 | $ 156 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 88.838 | NZD 136.213 | BOA | 4.414 | 0 | 4.414 | 0,05 |
| 01/2016 | NZD 354 | $ 230 | BOA | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | 132.288 | 90.865 | BPS | 300 | 0 | 300 | 0,00 |
| 01/2016 | 5.213 | 3.569 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 436 | 298 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 71.410 | NZD 109.666 | CBK | 3.668 | 0 | 3.668 | 0,05 |
| 01/2016 | 593 | 879 | HUS | 8 | 0 | 8 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 86.227 | NZD 132.408 | JPM | $ 4.420 | $ 0 | $ 4.420 | 0,06 |
| 01/2016 | NZD 132.222 | $ 90.570 | JPM | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 86.435 | NZD 132.250 | SCX | 4.103 | 0 | 4.103 | 0,05 |
| 01/2016 | NZD 114.243 | $ 78.228 | UAG | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 90.566 | NZD 132.288 | AZD | 0 | (180) | (180) | 0,00 |
| 02/2016 | 90.711 | 132.288 | BPS | 0 | (325) | (325) | 0,00 |
| 02/2016 | NZD 30 | $ 20 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 90.449 | NZD 132.272 | JPM | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| 02/2016 | 78.094 | 114.243 | UAG | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | | | | $ 17.136 | $ (629) | $ 16.507 | 0,21 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 27.951 | SEK 243.759 | BOA | $ 962 | $ 0 | $ 962 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 241.412 | $ 28.913 | BOA | 278 | 0 | 278 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 27.843 | SEK 243.672 | BPS | 1.061 | 0 | 1.061 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 7.217 | $ 856 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 242.619 | 29.102 | CBK | 324 | 0 | 324 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 28.165 | SEK 244.910 | CBK | 886 | 0 | 886 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK 242.284 | $ 28.941 | JPM | 203 | 0 | 203 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.734 | SEK 41.316 | MSB | 166 | 0 | 166 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK 209.672 | $ 25.015 | MSB | 144 | 0 | 144 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 18.615 | SEK 162.330 | SCX | 640 | 0 | 640 | 0,01 |
| 02/2016 | 28.936 | 241.412 | BOA | 0 | (276) | (276) | 0,00 |
| 02/2016 | 29.125 | 242.619 | CBK | 0 | (322) | (322) | 0,00 |
| 02/2016 | 28.964 | 242.284 | JPM | 0 | (202) | (202) | 0,00 |
| 02/2016 | 25.035 | 209.672 | MSB | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| | | | | $ 4.664 | $ (944) | $ 3.720 | 0,05 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 443 | $ 312 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 240 | SGD 338 | BRC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 9.851 | 13.963 | DUB | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | 19.570 | 27.606 | HUS | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| 02/2016 | 19.683 | 27.711 | SCX | 0 | (184) | (184) | (0,01) |
| | | | | $ 0 | $ (355) | $ (355) | (0,01) |

**(o) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 37.569 | $ 41.001 | $ (157) | $ 0 | $ (157) | 0,00 |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(p) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,250 % | 28.12.2015 | 04.01.2016 | $ 39.500 | $ (39.505) | (0,50) |
| CFR | (0,750 %) | 13.11.2015 | 11.11.2017 | 5.724 | (5.718) | (0,07) |
| GRE | 0,950 % | 24.12.2015 | 04.01.2016 | 15.500 | (15.503) | (0,20) |
| GRE | 1,200 % | 28.12.2015 | 04.01.2016 | 20.738 | (20.740) | (0,26) |
| IND | (0,100 %) | 05.11.2015 | 04.02.2016 | € 38.244 | (41.538) | (0,53) |
| SCX | 0,760 % | 13.11.2015 | 11.02.2016 | £ 224 | (330) | (0,01) |
| SCX | 0,770 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 6.451 | (9.518) | (0,12) |
| | | | | | $ (132.852) | (1,69) |

**(q) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 0,637 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | £ 1.357 | $ (2.010) | (0,03) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 6 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(r) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1.398) | $ 1.310 | $ (88) |
| BOA | 76.240 | (80.530) | (4.290) |
| BPS | 14.193 | (14.220) | (27) |
| BRC | (3.852) | 3.960 | 108 |
| CBK | (2.303) | 2.510 | 207 |
| DUB | 990 | (12.220) | (11.230) |
| FBF | 6.293 | (6.640) | (347) |
| GLM | (10.877) | 7.920 | (2.957) |
| GST | (1.260) | 1.260 | 0 |
| HUS | 23.448 | (24.370) | (922) |
| JPM | 69.570 | (71.470) | (1.900) |
| MSB | 7.573 | (8.120) | (547) |
| MYC | (3.334) | 2.940 | (394) |
| NAB | 102 | 0 | 102 |
| NGF | 48 | 0 | 48 |
| RBC | 3 | 0 | 3 |
| RYL | (3) | 0 | (3) |
| SCX | 3.964 | (4.150) | (186) |
| SOG | (314) | 320 | 6 |
| TOR | 14 | 0 | 14 |
| UAG | (30.847) | 37.160 | 6.313 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(s) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 111,34 | 117,28 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,18) | 0,13 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,37) | (0,34) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,24 | 2,93 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (5,89) | (9,93) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,67 | 1,09 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 381.770.461 | $ 3.820.177 |
| Japan Treasury Bills (0,047)% fällig am 14.03.2016 | JPY | 59.140.000 | 482.940 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 196.700 | 234.822 |
| Spain Government Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 185.700 | 211.205 |
| Japan Treasury Bills (0,100)% fällig am 22.02.2016 | JPY | 22.390.000 | 181.659 |
| Japan Treasury Bills (0,035)% fällig am 28.12.2015 | | 18.870.000 | 158.180 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | € | 53.925 | 80.452 |
| Spain Government Bond 4,400 % fällig am 31.10.2023 | | 54.400 | 71.911 |
| US Treasury Bonds 2,750 % fällig am 15.11.2042 | $ | 75.800 | 69.604 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 51.025 | 64.766 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | $ | 66.812 | 64.701 |
| Nykredit Realkredit 1,000 % fällig am 01.10.2016 | DKK | 420.200 | 64.131 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 42.700 | 59.541 |
| Spain Government Bond 4,650 % fällig am 30.07.2025 | | 41.650 | 58.300 |
| Japan Treasury Bills (0,086)% fällig am 07.03.2016 | JPY | 6.550.000 | 53.458 |
| US Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045 | $ | 42.655 | 42.444 |
| Dukinfield PLC 1,573 % fällig am 15.08.2045 | £ | 28.000 | 42.050 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 175.600 | 40.512 |
| Nykredit Realkredit 3,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 271.700 | 40.446 |
| United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 20.700 | 37.018 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 416.775.347 | $ 4.170.300 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 130.400 | 187.145 |
| Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 19.200.000 | 168.290 |
| Japan Treasury Bills (0,035)% fällig am 28.12.2015 | | 18.870.000 | 157.178 |
| Spain Government Bond 4,400 % fällig am 31.10.2023 | € | 107.200 | 141.260 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 96.450 | 114.159 |
| Spain Government Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 91.900 | 101.229 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 354.000 | 93.277 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | € | 49.400 | 77.874 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 369.800 | 75.114 |
| FMS Wertmanagement 1,875 % fällig am 09.05.2019 | € | 60.000 | 72.046 |
| US Treasury Notes 1,750 % fällig am 15.05.2023 | $ | 72.300 | 70.783 |
| Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.12.2044 | JPY | 8.010.000 | 68.095 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 45.300 | 59.694 |
| Spain Government Bond 4,650 % fällig am 30.07.2025 | | 41.650 | 56.261 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 240.200 | 52.766 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2016 | | 193.700 | 49.677 |
| United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 26.200 | 44.311 |
| France Government Bond 1,750 % fällig am 25.05.2023 | € | 36.000 | 42.794 |
| US Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043 | $ | 38.100 | 42.288 |

(a) Der Global Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **General Electric Capital Australia Funding Pty Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.01.2018 | AUD | 2.000 | $ 1.497 | 0,21 |
| **New South Wales Treasury Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.11.2025 (a) | | 2.500 | 2.642 | 0,37 |
| 4,000 % fällig am 20.05.2026 | | 1.500 | 1.170 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2022 | | 500 | 433 | 0,06 |
| **Queensland Treasury Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 21.07.2023 | | 200 | 156 | 0,02 |
| **TORRENS Trust** | | | | |
| 2,485 % fällig am 19.10.2038 | | 195 | 142 | 0,02 |
| **Westpac Banking Corp.** | | | | |
| 1,850 % fällig am 26.11.2018 | $ | 1.600 | 1.597 | 0,23 |
| | | | 7.637 | 1,08 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 1.800 | 1.967 | 0,28 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | | 1.100 | 1.099 | 0,15 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 2.900 | 2.664 | 0,38 |
| | | | 3.763 | 0,53 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 3.100 | 3.086 | 0,44 |
| **KANADA** | | | | |
| **Canada Government Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (a) | CAD | 770 | 678 | 0,10 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 0,933 % fällig am 01.06.2020 | | 843 | 599 | 0,08 |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | | 2.011 | 1.438 | 0,20 |
| 1,133 % fällig am 01.08.2020 | | 785 | 561 | 0,08 |
| **National Bank of Canada** | | | | |
| 2,200 % fällig am 19.10.2016 | $ | 3.000 | 3.028 | 0,43 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 2.700 | 1.936 | 0,27 |
| 2,350 % fällig am 01.06.2025 | | 2.800 | 2.011 | 0,28 |
| **Province of British Columbia** | | | | |
| 2,700 % fällig am 18.12.2022 | | 800 | 610 | 0,09 |
| 4,300 % fällig am 18.06.2042 | | 400 | 350 | 0,05 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,100 % fällig am 08.09.2018 | | 2.000 | 1.484 | 0,21 |
| 2,450 % fällig am 29.06.2022 | $ | 800 | 794 | 0,11 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 | CAD | 3.200 | 2.492 | 0,35 |
| 3,450 % fällig am 02.06.2045 | | 1.600 | 1.205 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 02.06.2024 | | 3.700 | 2.934 | 0,41 |
| 4,000 % fällig am 02.06.2021 | | 400 | 324 | 0,05 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2023 | | 3.100 | 2.383 | 0,34 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 2.000 | 1.589 | 0,22 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | | 1.600 | 1.318 | 0,19 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2038 | | 1.400 | 1.293 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2041 | | 200 | 187 | 0,03 |
| | | | 27.214 | 3,84 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Goldentree Loan Opportunities V Ltd.** | | | | |
| 1,010 % fällig am 18.10.2021 | $ | 322 | 321 | 0,05 |
| **Hillmark Funding Ltd.** | | | | |
| 0,628 % fällig am 21.05.2021 | | 1.265 | 1.243 | 0,17 |
| **Landmark VIII CLO Ltd.** | | | | |
| 0,555 % fällig am 19.10.2020 | | 1.669 | 1.658 | 0,23 |
| **OHA Credit Partners VI Ltd.** | | | | |
| 1,582 % fällig am 15.05.2023 | | 1.684 | 1.676 | 0,24 |
| | | | 4.898 | 0,69 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CHINA** | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.04.2017 | $ | 1.600 | $ 1.595 | 0,22 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | CZK | 41.000 | 1.650 | 0,23 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 35.000 | 5.123 | 0,72 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2016 | | 10.500 | 1.552 | 0,22 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2016 | | 32.500 | 4.770 | 0,67 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 40.500 | 5.921 | 0,84 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2037 | | 3.759 | 528 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 34.567 | 4.989 | 0,70 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 16.400 | 2.387 | 0,34 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 97.600 | 14.269 | 2,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 17.800 | 2.581 | 0,36 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 7.274 | 1.051 | 0,15 |
| | | | 43.171 | 6,09 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **Finnvera OYJ** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | € | 1.000 | 1.092 | 0,15 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Caisse Francaise de Financement Local** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.02.2017 | $ | 1.500 | 1.565 | 0,22 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 500 | 553 | 0,08 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.07.2017 | £ | 300 | 446 | 0,06 |
| 1,875 % fällig am 29.01.2020 | $ | 2.800 | 2.756 | 0,39 |
| 2,250 % fällig am 30.01.2019 | | 2.300 | 2.316 | 0,33 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.11.2018 (b) | € | 18.000 | 20.237 | 2,85 |
| 1,000 % fällig am 25.11.2025 | | 700 | 761 | 0,11 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 3.800 | 5.249 | 0,74 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2038 | | 3.600 | 5.475 | 0,77 |
| 4,500 % fällig am 25.04.2041 | | 7.000 | 11.555 | 1,63 |
| | | | 50.913 | 7,18 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **KFW** | | | | |
| 2,875 % fällig am 12.10.2016 | NOK | 7.800 | 894 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 100 | 82 | 0,01 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | | 1.500 | 1.153 | 0,16 |
| 5,375 % fällig am 23.04.2024 | NZD | 1.100 | 807 | 0,12 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 4,000 % fällig am 04.01.2037 | € | 2.900 | 4.673 | 0,66 |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 | | 2.000 | 3.417 | 0,48 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2023 (a) | | 829 | 945 | 0,13 |
| | | | 11.971 | 1,69 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 190.000 | 1.524 | 0,22 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 100 | 101 | 0,01 |
| **National Bank of Greece S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.10.2016 | | 800 | 850 | 0,12 |
| | | | 2.475 | 0,35 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities No.3 Ltd.** | | | | |
| 1,142 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 13.733 | 1.587 | 0,22 |
| **Depfa ACS Bank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | € | 2.000 | 2.241 | 0,32 |
| 4,875 % fällig am 21.05.2019 | | 600 | 752 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 16.03.2037 | $ | 700 | 858 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Mercator CLO II PLC** | | | | |
| 0,149 % fällig am 18.02.2024 | € | 137 | $ 147 | 0,02 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO China Bond Fund (c) | | 370.799 | 4.109 | 0,58 |
| | | | 9.694 | 1,37 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Berica 8 Residential MBS Srl** | | | | |
| 0,229 % fällig am 31.03.2048 | $ | 1.041 | 1.110 | 0,16 |
| **Berica ABS Srl** | | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | | 158 | 170 | 0,02 |
| **Claris ABS Srl** | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | | 1.327 | 1.420 | 0,20 |
| **Claris RMBS Srl** | | | | |
| 1,019 % fällig am 28.12.2061 | | 1.358 | 1.481 | 0,21 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.09.2046 | | 1.400 | 1.702 | 0,24 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 | | 3.100 | 4.203 | 0,59 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | | 3.300 | 4.455 | 0,63 |
| 4,750 % fällig am 01.09.2044 | | 1.700 | 2.613 | 0,37 |
| 5,000 % fällig am 01.09.2040 | | 5.000 | 7.732 | 1,09 |
| **Marche M5 Srl** | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | | 313 | 340 | 0,05 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 815 | 867 | 0,12 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 1.358 | 1.497 | 0,21 |
| **Mars 2600 Srl** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 219 | 240 | 0,03 |
| **MONVISO SRL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 23.06.2027 | | 1.033 | 1.124 | 0,16 |
| **Republik Italien** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 100 | 178 | 0,03 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,620 % fällig am 27.11.2031 | € | 1.109 | 1.198 | 0,17 |
| 0,649 % fällig am 27.12.2032 | | 3.400 | 3.699 | 0,52 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 214 | 232 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 400 | 411 | 0,06 |
| | | | 34.672 | 4,89 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 05.03.2018 | $ | 900 | 893 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 8.710.000 | 78.726 | 11,11 |
| 1,500 % fällig am 20.12.2044 | | 270.000 | 2.375 | 0,33 |
| 1,700 % fällig am 20.09.2044 | | 290.000 | 2.669 | 0,38 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,050 %) fällig am 20.01.2016 | | 140.000 | 1.164 | 0,16 |
| (0,030 %) fällig am 14.03.2016 | | 7.410.000 | 61.601 | 8,69 |
| | | | 146.535 | 20,67 |
| Summe Japan | | | 147.428 | 20,80 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | $ | 1.700 | 1.686 | 0,24 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,082 % fällig am 20.08.2021 | € | 852 | 925 | 0,13 |
| **DECO Charlemagne S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 27.04.2025 | | 1.391 | 1.513 | 0,22 |
| **ECAR** | | | | |
| 0,852 % fällig am 18.11.2020 | | 205 | 223 | 0,03 |
| | | | 2.661 | 0,38 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MEXIKO** | | | | |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | MXN | 49.100 | $ 2.860 | 0,40 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | | 6.770 | 432 | 0,06 |
| | | | 3.292 | 0,46 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Bank Nederlandse Gemeenten NV | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.06.2018 | $ | 300 | 298 | 0,04 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | | 1.700 | 1.754 | 0,25 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 2.400 | 2.585 | 0,36 |
| Euro-Galaxy CLO BV | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 359 | 388 | 0,05 |
| Lunet RMBS BV | | | | |
| 0,369 % fällig am 26.12.2045 | | 294 | 320 | 0,05 |
| Panther CDO V BV | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | | 485 | 507 | 0,07 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Stichting AK Rabobank Certificaten | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 400.000 | 485 | 0,07 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 0,822 % fällig am 15.12.2017 | $ | 1.600 | 1.745 | 0,25 |
| | | | 8.082 | 1,14 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| Eksportfinans ASA | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 600 | 625 | 0,09 |
| Kommunalbanken | | | | |
| 6,500 % fällig am 12.04.2021 | AUD | 2.700 | 2.289 | 0,32 |
| Norway Government Bond | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.300 | 730 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | | 3.700 | 478 | 0,07 |
| | | | 4.122 | 0,58 |
| **POLEN** | | | | |
| Poland Government International Bond | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 1.650 | 430 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | | 8.800 | 2.417 | 0,34 |
| | | | 2.847 | 0,40 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Banco Espirito Santo S.A. | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | € | 400 | 60 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 700 | 104 | 0,01 |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | | 900 | 851 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 400 | 381 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 200 | 194 | 0,03 |
| | | | 1.590 | 0,22 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 14.100 | 14.858 | 2,10 |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | € | 3.800 | 4.288 | 0,60 |
| 4,750 % fällig am 10.05.2018 | $ | 2.000 | 2.128 | 0,30 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 3.400 | 3.759 | 0,53 |
| Slovenska izvozna in razvojna banka dd | | | | |
| 0,875 % fällig am 04.08.2018 | € | 1.100 | 1.212 | 0,17 |
| | | | 26.245 | 3,70 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| South Africa Government International Bond | | | | |
| 8,000 % fällig am 21.12.2018 | ZAR | 10.900 | 688 | 0,10 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | $ | 2.400 | 2.399 | 0,34 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.200 | $ 1.277 | 0,18 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 3.000 | 3.072 | 0,43 |
| | | | 4.349 | 0,61 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| BANCAJA 6 Fondo de Titulizacion de Activos | | | | |
| 0,158 % fällig am 20.02.2036 | | 104 | 109 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 | | 1.300 | 1.430 | 0,20 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 600 | 690 | 0,10 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 500 | 587 | 0,08 |
| Autonomous Community of Madrid | | | | |
| 4,125 % fällig am 21.05.2024 | | 1.000 | 1.277 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2018 | | 1.600 | 1.933 | 0,27 |
| Comunidad Autonoma de Aragon | | | | |
| 1,150 % fällig am 30.07.2017 | | 2.300 | 2.531 | 0,36 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 12.000 | 13.481 | 1,90 |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 8.700 | 10.318 | 1,45 |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 12.700 | 16.205 | 2,29 |
| 4,700 % fällig am 30.07.2041 | | 300 | 432 | 0,06 |
| 4,800 % fällig am 31.01.2024 | | 1.900 | 2.587 | 0,36 |
| 4,900 % fällig am 30.07.2040 | | 2.300 | 3.388 | 0,48 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2028 | | 3.300 | 4.778 | 0,67 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 3.075 | 4.745 | 0,67 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 500 | 830 | 0,12 |
| Xunta de Galicia | | | | |
| 5,763 % fällig am 03.04.2017 | € | 2.175 | 2.523 | 0,36 |
| | | | 67.735 | 9,55 |
| Summe Spanien | | | 72.193 | 10,18 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| EUROFIMA | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.12.2018 | AUD | 2.900 | 2.319 | 0,33 |
| Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | | 3.100 | 1.732 | 0,24 |
| Europäische Investitionsbank | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.07.2023 | | 1.200 | 677 | 0,10 |
| Europäischer Stabilitätsmechanismus | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.09.2025 | € | 200 | 221 | 0,03 |
| Nordic Investment Bank | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.04.2022 | AUD | 900 | 723 | 0,10 |
| | | | 5.672 | 0,80 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB | | | | |
| 3,000 % fällig am 20.06.2018 | SEK | 2.500 | 318 | 0,05 |
| Stadshypotek AB | | | | |
| 3,000 % fällig am 21.03.2018 | | 4.000 | 507 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 10.10.2017 | AUD | 3.400 | 2.527 | 0,36 |
| Sveriges Sakerstallda Obligationer AB | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.03.2018 | SEK | 4.000 | 516 | 0,07 |
| Swedbank AB | | | | |
| 2,200 % fällig am 04.03.2020 | $ | 1.300 | 1.286 | 0,18 |
| Swedbank Hypotek AB | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | SEK | 5.100 | 649 | 0,09 |
| Sweden Government Bond | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.03.2019 | | 5.700 | 771 | 0,11 |
| | | | 6.574 | 0,93 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| UBS AG | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | $ | 300 | 306 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 1.800 | 1.883 | 0,27 |
| | | | 2.189 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| Abu Dhabi National Energy Co. PJSC | | | | |
| 2,500 % fällig am 12.01.2018 | $ | 500 | $ 498 | 0,07 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| Motor PLC | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2021 | | 481 | 481 | 0,07 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 2.390 | 2.726 | 0,38 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 2.500 | 2.672 | 0,38 |
| Barclays PLC | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.300 | 1.434 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 300 | 443 | 0,06 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.500 | 1.602 | 0,23 |
| HBOS PLC | | | | |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | | 4.800 | 4.790 | 0,68 |
| HSBC Holdings PLC | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.500 | 1.644 | 0,23 |
| InterContinental Hotels Group PLC | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | £ | 900 | 1.323 | 0,19 |
| Lloyds Bank PLC | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | | 1.100 | 1.929 | 0,27 |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.600 | 2.283 | 0,32 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | | | | |
| 4,700 % fällig am 03.07.2018 | | 400 | 415 | 0,06 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 1.000 | 1.085 | 0,15 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 600 | 900 | 0,13 |
| Tesco PLC | | | | |
| 5,000 % fällig am 24.03.2023 | | 100 | 144 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 950 | 1.468 | 0,21 |
| Tesco Property Finance 2 PLC | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 275 | 382 | 0,05 |
| Virgin Media Secured Finance PLC | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 1.000 | 1.357 | 0,19 |
| | | | 26.597 | 3,75 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Aggregator of Loans Backed by Assets PLC | | | | |
| 1,754 % fällig am 24.04.2049 | | 2.074 | 3.027 | 0,43 |
| Auburn Securities 9 PLC | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 1.158 | 1.697 | 0,24 |
| Dukinfield PLC | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | | 2.216 | 3.208 | 0,45 |
| Eurosail PLC | | | | |
| 0,743 % fällig am 10.06.2044 | | 493 | 705 | 0,10 |
| Gemgarto | | | | |
| 3,523 % fällig am 14.05.2045 | | 156 | 233 | 0,03 |
| Lanark Master Issuer PLC | | | | |
| 2,202 % fällig am 22.12.2054 | | 1.500 | 2.245 | 0,32 |
| Leek Finance Number Eighteen PLC | | | | |
| 0,830 % fällig am 21.09.2038 | $ | 555 | 585 | 0,08 |
| Logistics UK PLC | | | | |
| 1,821 % fällig am 20.08.2025 | £ | 1.100 | 1.626 | 0,23 |
| Mansard Mortgages PLC | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | | 1.574 | 2.237 | 0,32 |
| Newgate Funding | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 980 | 987 | 0,14 |
| Paragon Mortgages No.13 PLC | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 2.651 | 3.510 | 0,50 |
| Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC | | | | |
| 0,025 % fällig am 12.06.2044 | € | 1.761 | 1.733 | 0,24 |
| Residential Mortgage Securities 28 PLC | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | £ | 684 | 999 | 0,14 |
| Tenterden Funding PLC | | | | |
| 2,085 % fällig am 21.03.2044 | | 1.329 | 1.979 | 0,28 |
| | | | 24.771 | 3,50 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 12.900 | $ 21.194 | 2,99 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 2.100 | 3.616 | 0,51 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 | | 1.700 | 3.241 | 0,46 |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 | | 200 | 403 | 0,05 |
| | | | 28.454 | 4,01 |
| Summe Großbritannien | | | 80.303 | 11,33 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 1,270 % fällig am 25.04.2038 | $ | 519 | 517 | 0,07 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 700 | 702 | 0,10 |
| **BA Covered Bond Issuer** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.04.2017 | € | 100 | 114 | 0,02 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | $ | 1.000 | 1.104 | 0,15 |
| 7,750 % fällig am 30.04.2018 | £ | 500 | 833 | 0,12 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | $ | 700 | 698 | 0,10 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 200 | 200 | 0,03 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 3.100 | 3.139 | 0,44 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,476 % fällig am 23.04.2020 | | 1.600 | 1.604 | 0,23 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 2.100 | 2.167 | 0,30 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc. (d)** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2009 | | 700 | 53 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 | | 600 | 45 | 0,01 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 | | 1.400 | 107 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 | £ | 1.800 | 239 | 0,03 |
| **SABMiller Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.01.2042 | $ | 1.600 | 1.629 | 0,23 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.07.2025 | | 600 | 619 | 0,09 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.05.2023 | | 1.500 | 1.460 | 0,21 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | | 1.100 | 1.071 | 0,15 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 1.800 | 1.772 | 0,25 |
| | | | 17.556 | 2,48 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,757 % fällig am 25.09.2035 | | 94 | 78 | 0,01 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 20.02.2047 (d) | | 2.239 | 1.690 | 0,24 |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (d) | | 580 | 426 | 0,06 |
| 0,672 % fällig am 25.10.2046 (d) | | 187 | 134 | 0,02 |
| 0,692 % fällig am 25.05.2036 (d) | | 40 | 39 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2037 (d) | | 171 | 105 | 0,02 |
| 0,923 % fällig am 20.11.2035 (d) | | 156 | 120 | 0,02 |
| 1,192 % fällig am 25.11.2035 | | 425 | 368 | 0,05 |
| 1,674 % fällig am 25.11.2035 | | 199 | 164 | 0,02 |
| 2,214 % fällig am 25.11.2035 | | 80 | 67 | 0,01 |
| 2,307 % fällig am 20.10.2035 | | 3.728 | 3.336 | 0,47 |
| 2,673 % fällig am 25.02.2037 (d) | | 614 | 553 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 (d) | | 72 | 66 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 (d) | | 117 | 101 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2036 (d) | | 333 | 272 | 0,04 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.05.2046 (d) | | 636 | 469 | 0,07 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 0,921 % fällig am 25.10.2031 | | 6 | 5 | 0,00 |
| 1,002 % fällig am 25.07.2032 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,122 % fällig am 25.06.2034 | | 214 | 201 | 0,03 |
| **Banc of America Funding Trust (d)** | | | | |
| 3,007 % fällig am 20.01.2047 | | 179 | 152 | 0,02 |
| 3,203 % fällig am 20.10.2046 | | 250 | 190 | 0,03 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.10.2031 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,651 % fällig am 17.02.2051 | $ | 1.389 | $ 1.407 | 0,20 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,458 % fällig am 25.05.2034 | | 49 | 46 | 0,01 |
| 2,480 % fällig am 25.08.2035 | | 653 | 656 | 0,09 |
| 2,601 % fällig am 25.08.2033 | | 31 | 31 | 0,00 |
| 2,608 % fällig am 25.10.2033 | | 55 | 56 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | | 451 | 453 | 0,06 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (d) | | 752 | 678 | 0,10 |
| 2,924 % fällig am 25.03.2035 | | 29 | 30 | 0,00 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 2,702 % fällig am 25.11.2036 (d) | | 867 | 629 | 0,09 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | | 960 | 816 | 0,12 |
| 2,741 % fällig am 25.11.2035 (d) | | 377 | 284 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.04.2031 | | 78 | 79 | 0,01 |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | | 573 | 533 | 0,08 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | | 1.314 | 973 | 0,14 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,420 % fällig am 25.09.2035 | | 238 | 239 | 0,03 |
| 2,905 % fällig am 25.09.2037 (d) | | 1.233 | 1.120 | 0,16 |
| 3,641 % fällig am 25.08.2035 (d) | | 1.740 | 1.487 | 0,21 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,399 % fällig am 25.09.2035 (d) | | 1.953 | 1.693 | 0,24 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.09.2036 | | 184 | 182 | 0,03 |
| 0,762 % fällig am 25.12.2036 (d) | | 29 | 21 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | | 67 | 58 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | | 392 | 313 | 0,04 |
| 1,082 % fällig am 25.02.2035 | | 164 | 152 | 0,02 |
| 1,182 % fällig am 25.09.2034 | | 25 | 24 | 0,00 |
| 2,646 % fällig am 25.11.2034 | | 24 | 23 | 0,00 |
| 2,713 % fällig am 25.08.2034 (d) | | 64 | 56 | 0,01 |
| 2,745 % fällig am 19.11.2033 | | 42 | 42 | 0,01 |
| 2,766 % fällig am 25.08.2034 (d) | | 32 | 28 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Deutsche Alternative-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.10.2036 (d) | | 8 | 5 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 19.08.2045 | | 228 | 196 | 0,03 |
| 0,722 % fällig am 19.07.2045 (d) | | 61 | 8 | 0,00 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 1,422 % fällig am 25.05.2043 | | 43 | 44 | 0,01 |
| 1,443 % fällig am 25.10.2044 | | 495 | 504 | 0,07 |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | | 187 | 190 | 0,03 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,723 % fällig am 25.08.2035 | | 91 | 81 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.11.2045 | | 35 | 31 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp. II** | | | | |
| 2,329 % fällig am 10.11.2045 | | 3.425 | 330 | 0,05 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,860 % fällig am 25.03.2033 | | 47 | 46 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 19.09.2046 (d) | | 9 | 1 | 0,00 |
| 1,107 % fällig am 19.12.2036 (d) | | 352 | 295 | 0,04 |
| 2,574 % fällig am 19.05.2033 | | 93 | 92 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.08.2035 | | 426 | 425 | 0,06 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (d) | | 307 | 166 | 0,02 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 1,422 % fällig am 25.07.2033 | | 8 | 8 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,656 % fällig am 25.03.2036 | | 1.384 | 1.056 | 0,15 |
| 2,691 % fällig am 25.12.2034 | | 41 | 39 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 (d) | | 2 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,048 % fällig am 27.07.2037 | | 713 | 667 | 0,09 |
| 2,104 % fällig am 25.11.2033 | | 25 | 24 | 0,00 |
| 2,609 % fällig am 25.02.2036 (d) | | 458 | 401 | 0,06 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.11.2046 (d) | $ | 97 | $ 26 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.03.2036 (d) | | 106 | 26 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,771 % fällig am 15.12.2030 | | 61 | 58 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,502 % fällig am 25.09.2037 | | 8 | 3 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2036 | | 21 | 21 | 0,00 |
| 1,904 % fällig am 25.10.2035 | | 323 | 315 | 0,05 |
| **NCUA Guaranteed Notes Trust** | | | | |
| 0,746 % fällig am 05.11.2020 | | 1.861 | 1.870 | 0,26 |
| 0,829 % fällig am 08.12.2020 | | 1.893 | 1.906 | 0,27 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,431 % fällig am 26.10.2036 | | 607 | 618 | 0,09 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.12.2033 | | 25 | 23 | 0,00 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 0,561 % fällig am 25.06.2035 | | 464 | 408 | 0,06 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | | 346 | 189 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2047 | | 2.852 | 2.271 | 0,32 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2046 | | 1.226 | 524 | 0,07 |
| 0,822 % fällig am 25.10.2045 | | 243 | 175 | 0,03 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.11.2035 | | 500 | 434 | 0,06 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,982 % fällig am 25.06.2032 | | 6 | 5 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.09.2035 (d) | | 108 | 87 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 (d) | | 18 | 7 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 0,752 % fällig am 20.07.2033 | | 71 | 67 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | | 2.646 | 2.438 | 0,34 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 25.04.2034 | | 167 | 168 | 0,02 |
| 2,586 % fällig am 25.02.2034 | | 77 | 78 | 0,01 |
| 2,737 % fällig am 25.09.2034 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.07.2046 (d) | | 988 | 784 | 0,11 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | | 302 | 238 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2036 | | 1.967 | 1.479 | 0,21 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2046 (d) | | 76 | 31 | 0,00 |
| 0,982 % fällig am 19.07.2034 | | 32 | 32 | 0,01 |
| 1,102 % fällig am 19.03.2034 | | 14 | 13 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2035 | | 227 | 218 | 0,03 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.06.2047 (d) | | 398 | 356 | 0,05 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 25.01.2045 | | 89 | 84 | 0,01 |
| 1,237 % fällig am 25.06.2046 | | 974 | 915 | 0,13 |
| 1,257 % fällig am 25.02.2046 | | 720 | 664 | 0,09 |
| 1,899 % fällig am 27.02.2034 | | 33 | 32 | 0,01 |
| 2,439 % fällig am 25.03.2034 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 4,432 % fällig am 25.05.2037 (d) | | 1.850 | 1.640 | 0,23 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 1,197 % fällig am 25.07.2046 (d) | | 167 | 107 | 0,02 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,743 % fällig am 25.09.2034 | | 68 | 70 | 0,01 |
| | | | 43.667 | 6,16 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dauphin, Pennsylvania, Pennsylvania Turnpike Commission Revenue Bonds, Series 2009** | | | | |
| 6,105 % fällig am 01.12.2039 | | 300 | 373 | 0,05 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,600 % fällig am 01.11.2040 | | 100 | 149 | 0,02 |
| 7,950 % fällig am 01.03.2036 | | 200 | 239 | 0,04 |
| | | | 761 | 0,11 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,522 % fällig am 25.01.2021 | $ 2 | $ 2 | 0,00 |
| 0,542 % fällig am 25.03.2034 | 40 | 40 | 0,01 |
| 0,552 % fällig am 25.03.2036 | 28 | 27 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2034 | 37 | 37 | 0,00 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2040 | 740 | 743 | 0,10 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2040 | 1.242 | 1.249 | 0,18 |
| 0,922 % fällig am 25.10.2040 - 25.12.2040 | 1.136 | 1.140 | 0,16 |
| 1,443 % fällig am 01.09.2044 | 189 | 193 | 0,03 |
| 2,022 % fällig am 01.10.2034 | 23 | 25 | 0,00 |
| 2,255 % fällig am 01.12.2034 | 66 | 68 | 0,01 |
| 2,505 % fällig am 01.01.2036 | 49 | 53 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 01.11.2034 | 292 | 309 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 01.04.2043 - 01.06.2043 | 196 | 197 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2021 | 930 | 993 | 0,14 |
| 4,295 % fällig am 01.06.2021 | 966 | 1.053 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 264 | 297 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 01.08.2037 | 37 | 37 | 0,01 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ 8.000 | $ 8.001 | 1,13 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | 10.800 | 11.120 | 1,57 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,931 % fällig am 15.12.2037 - 15.07.2040 | 683 | 689 | 0,10 |
| 2,521 % fällig am 01.09.2035 | 17 | 18 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,625 % fällig am 20.11.2022 | 8 | 8 | 0,00 |
| | | 26.299 | 3,71 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 - 15.01.2023 (e)(f) | 30.479 | 29.394 | 4,15 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 24.100 | 23.026 | 3,25 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 7.723 | 7.483 | 1,05 |
| 1,375 % fällig am 15.01.2020 | 440 | 458 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 454 | 497 | 0,07 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 - 15.01.2027 | 716 | 826 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | $ 332 | $ 394 | 0,05 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2027 | 800 | 1.108 | 0,16 |
| **US Treasury Strips** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.11.2023 - 15.05.2026 | 5.100 | 4.114 | 0,58 |
| | | 67.300 | 9,49 |
| Summe USA | | 156.100 | 22,02 |
| | | **AKTIEN** | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 10.812 | 108 | 0,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 730.475** | **103,04** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Verfalls-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 30 | $ (21) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 23 | (10) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 19 | (15) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 32 | (18) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 14 | 4 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 75 | (151) | (0,02) |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 303 | (374) | (0,05) |
| Euro-Bono Spanish Government Bond March Futures | Short | 03/2016 | 3 | 10 | 0,00 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 207 | (154) | (0,02) |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 219 | 405 | 0,06 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 7 | (21) | 0,00 |
| Euro-OAT March Futures | Long | 03/2016 | 186 | (405) | (0,06) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 381 | 35 | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 21 | 52 | 0,01 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 86 | (23) | (0,01) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 197 | (50) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.008 | (324) | (0,05) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 16 | (6) | 0,00 |
| | | | | $ (1.066) | (0,15) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (1.066)** | **(0,15)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 4.158 | $ (133) | (0,02) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 3.600 | 3 | 0,00 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 500 | (2) | 0,00 |
| iTraxx Europe Senior Financials Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 42.700 | (17) | 0,00 |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 12.100 | 16 | 0,00 |
| | | | | $ (133) | (0,02) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,013 % | 23.01.2025 | SEK 7.200 | $ (27) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,023 % | 23.01.2025 | 5.900 | (21) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,033 % | 23.01.2025 | 6.100 | (21) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,036 % | 23.01.2025 | 6.900 | (24) | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,080 % | 26.01.2025 | SEK 3.300 | $ (10) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 1,085 % | 26.01.2025 | 3.900 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 16.12.2016 | $ 76.100 | (53) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | 245.100 | (479) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | 107.900 | (305) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 106.300 | (2.655) | (0,38) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 13.01.2023 | 10.300 | (174) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 80.800 | 275 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 16.12.2035 | 600 | (37) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,500 % | 17.12.2025 | AUD 3.000 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.06.2026 | 1.600 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,493 % | 16.03.2021 | € 51.400 | 328 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 30.11.2025 | 7.500 | 17 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 34.000 | (25) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,564 % | 30.11.2045 | 5.000 | 57 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 4.800 | 37 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 7.300 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.09.2018 | 22.600 | (244) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 9.500 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 3.000 | (87) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 2.900 | (97) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,150 % | 22.03.2018 | JPY 12.200.000 | 43 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 % | 18.09.2022 | 2.430.000 | (299) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 18.12.2025 | 2.620.000 | 196 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,250 % | 17.06.2035 | 410.000 | 107 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2045 | 510.000 | 135 | 0,02 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,340 % | 28.09.2017 | MXN 90.400 | (9) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,195 % | 05.10.2017 | 67.500 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,130 % | 17.10.2017 | 203.800 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 4,260 % | 31.10.2017 | 146.500 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,010 % | 10.10.2019 | 99.500 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,615 % | 02.06.2020 | 330.700 | 61 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 11.10.2021 | 11.700 | (20) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,620 % | 09.11.2021 | 10.300 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 18.07.2022 | 70.600 | 23 | 0,00 |
| | | | | | $ (3.350) | (0,47) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (3.483)** | **(0,49)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 900 | $ 41 | $ 48 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,000 | 28.03.2016 | 4.700 | 205 | 249 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNY 6,520 | 31.10.2016 | 164 | 50 | 115 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 125,100 | 27.01.2016 | 3.500 | 25 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 321 | $ 413 | 0,06 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 3.600 | $ (6) | $ (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 5.300 | (10) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 2.500 | (6) | (2) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | GST | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 7.200 | (4) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | GST | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 7.200 | (14) | (11) | 0,00 |
| | | | | | | $ (40) | $ (20) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 4,300 | 28.03.2016 | 900 | $ (19) | $ (23) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,300 | 28.03.2016 | 4.700 | (97) | (122) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,150 | 21.06.2016 | 4.200 | (144) | (1.043) | (0,15) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNY 6,600 | 05.02.2016 | 2.000 | (22) | (13) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 6,600 | 05.02.2016 | 1.760 | (20) | (11) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | AZD | 7,000 | 01.11.2016 | 1.100 | (13) | (18) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 7,000 | 01.11.2016 | 2.900 | (35) | (46) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | MSB | RUB 70,000 | 02.02.2016 | 1.000 | (17) | (53) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | CBK | 71,500 | 09.03.2016 | 700 | (15) | (37) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | BRL 3,800 | 28.03.2016 | 900 | (18) | (14) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 4.700 | (100) | (72) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | JPY 117,350 | 27.01.2016 | 7.100 | (51) | (13) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | KRW 1.082,500 | 19.01.2016 | 1.600 | (12) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | GLM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 500 | (4) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus South Korean won | JPM | 1.092,500 | 20.01.2016 | 1.700 | (13) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (580) | $ (1.465) | (0,21) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 0,400 % | 29.04.2016 | € 9.800 | $ (36) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,400 % | 29.04.2016 | 9.800 | (86) | (209) | (0,03) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 4.600 | (80) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 4.600 | (73) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 6.650 | (52) | (21) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 6.650 | (36) | (42) | (0,01) |
| | | | | | | | $ (363) | $ (273) | (0,04) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | £ 1,750 | 01.02.2016 | 7.300.000 | $ (54) | $ (8) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 2,300 | 01.02.2016 | 7.300.000 | (49) | (6) | 0,00 |
| | | | | | $ (103) | $ (14) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 217,965 | Maximal [1-(Final Index/Initial Index), 0] | 29.09.2020 | $ 1.300 | $ (17) | $ (1) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | BPS | $ 500 | $ 0 | $ 1 | $ (1) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.03.2017 | CBK | 1.300 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| UBS AG | (1,000 %) | 20.06.2018 | GST | 300 | 1 | 2 | (1) | 0,00 |
| UST LLC | (0,720 %) | 20.03.2018 | GST | 1.500 | (22) | 0 | (22) | 0,00 |
| | | | | | $ (23) | $ 3 | $ (26) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | $ 1.300 | $ (125) | $ (53) | $ (72) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | DUB | 500 | (58) | (15) | (43) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | HUS | 1.200 | (139) | (34) | (105) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 3.400 | (328) | (151) | (177) | (0,05) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 300 | (35) | (9) | (26) | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BOA | 1.900 | 4 | (15) | 19 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | BRC | 1.700 | 4 | (11) | 15 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | CBK | 1.300 | 3 | (12) | 15 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | CBK | 300 | 1 | (1) | 2 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | GST | 3.300 | 8 | (24) | 32 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | GST | 600 | 1 | (3) | 4 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | HUS | 700 | 2 | (4) | 6 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | JPM | 6.100 | 14 | (56) | 70 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.06.2020 | JPM | 500 | 1 | (3) | 4 | 0,00 |
| France Government Bond | 0,250 % | 20.03.2020 | MYC | 2.100 | 5 | (15) | 20 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 3.200 | 36 | (58) | 94 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | € 100 | (9) | (8) | (1) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 200 | (19) | (17) | (2) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | FBF | 200 | (19) | (16) | (3) | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 800 | (75) | (64) | (11) | (0,01) |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 200 | (19) | (16) | (3) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | SOG | € 1.200 | $ (112) | $ (103) | $ (9) | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 700 | (1) | (6) | 5 | 0,00 |
| | | | | | $ (860) | $ (694) | $ (166) | (0,12) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Sub Financials Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | BPS | € 700 | $ 20 | $ 15 | $ 5 | 0,00 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BOA | € 25.500 | $ 27.974 | $ 243 | $ (85) | $ 328 | 0,04 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | BOA | 2.280 | 2.472 | 39 | 8 | 31 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | BOA | 1.100 | 1.172 | 10 | (5) | 15 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.12.2020 | BPS | 11.100 | 12.032 | 148 | 14 | 134 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | BPS | 10.100 | 11.080 | 122 | (8) | 130 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | CBK | 16.900 | 18.539 | 161 | (56) | 217 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | CBK | 12.550 | 13.604 | 327 | 154 | 173 | 0,05 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,100 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | DUB | 14.200 | 15.577 | 172 | (10) | 182 | 0,02 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 15.06.2026 | DUB | 700 | 743 | 9 | (1) | 10 | 0,00 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | GLM | 3.400 | 3.686 | 100 | 53 | 47 | 0,01 |
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month JPY-LIBOR abzgl. 0,908 % basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2021 | MYC | $ 2.703 | JPY330.000 | (16) | (25) | 9 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.315 | $ 39 | $ 1.276 | 0,19 |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,320 % | 04.01.2016 | JPM | BRL 13.400 | $ (23) | $ (1) | $ (22) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 7.800 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | MYC | 16.500 | 31 | 14 | 17 | 0,00 |
| | | | | | | $ 22 | $ 13 | $ 9 | 0,00 |

## VOLATILITÄTSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 16.08.2016 | DUB | CHF 18 | $ 30 | $ 0 | $ 30 | 0,01 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,085 % | 16.08.2016 | DUB | 8 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,087 % | 16.08.2016 | DUB | 16 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,088 % | 16.08.2016 | DUB | 6 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,090 % | 16.08.2016 | DUB | 8 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | Euro - Schweizer Franken | 0,084 % | 06.12.2016 | DUB | 5 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,103 % | 16.08.2016 | DUB | (8) | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,105 % | 16.08.2016 | DUB | (8) | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,106 % | 16.08.2016 | DUB | (18) | (4) | 0 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,109 % | 16.08.2016 | DUB | (8) | (7) | 0 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,112 % | 16.08.2016 | DUB | (14) | (16) | 0 | (16) | 0,00 |
| Zahlung | US-Dollar - Schweizer Franken | 0,108 % | 06.12.2016 | DUB | (5) | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 84 | $ 0 | $ 84 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 25.847 | AUD | 35.553 | JPM | $ 20 | $ 0 | $ 20 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 35.553 | $ | 25.751 | UAG | 0 | (116) | (116) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 1.325 | BRL | 5.174 | BOA | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 5.174 | $ | 1.319 | BOA | 13 | (2) | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.033 | | 1.289 | BPS | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.288 | BRL | 5.033 | BPS | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 15.608 | $ | 3.997 | CBK | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3.991 | BRL | 15.608 | CBK | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| 01/2016 | | 6.872 | | 26.871 | DUB | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 26.871 | $ | 7.085 | DUB | 293 | 0 | 293 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 2.624 | BRL | 10.163 | FBF | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 10.163 | $ | 2.603 | FBF | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 01/2016 | | 30.058 | | 8.754 | JPM | 1.156 | 0 | 1.156 | 0,16 |
| 01/2016 | $ | 7.840 | BRL | 30.058 | JPM | 0 | (242) | (242) | (0,03) |
| 01/2016 | BRL | 3.846 | $ | 996 | UAG | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 985 | BRL | 3.846 | UAG | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.494 | CAD | 32.629 | BOA | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 32.629 | $ | 24.487 | JPM | 997 | 0 | 997 | 0,14 |
| 01/2016 | $ | 619 | CNH | 3.945 | CBK | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 5.847 | $ | 904 | JPM | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 01/2016 | CNY | 26.133 | | 4.082 | UAG | 90 | 0 | 90 | 0,01 |
| 01/2016 | DKK | 6.179 | | 945 | JPM | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| 01/2016 | | 10.119 | | 1.549 | MSB | 76 | 0 | 76 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 186.283 | € | 169.533 | BOA | 0 | (2.119) | (2.119) | (0,30) |
| 01/2016 | | 6.364 | | 5.999 | CBK | 153 | 0 | 153 | 0,02 |
| 01/2016 | € | 7.963 | $ | 8.628 | CBK | 35 | (57) | (22) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.345 | | 8.939 | GLM | 17 | (144) | (127) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 2.025 | € | 1.865 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.287 | | 2.081 | HUS | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 166.032 | $ | 176.936 | HUS | 0 | (3.424) | (3.424) | (0,48) |
| 01/2016 | | 1.554 | | 1.712 | JPM | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.193 | € | 4.775 | JPM | 10 | (16) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.894 | $ | 4.230 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.863 | € | 3.534 | UAG | 11 | (35) | (24) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 2.315 | $ | 3.491 | BOA | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3.646 | £ | 2.427 | BOA | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| 01/2016 | | 796 | | 533 | DUB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 41.115 | $ | 61.981 | DUB | 1.382 | 0 | 1.382 | 0,19 |
| 01/2016 | | 2.235 | | 3.362 | JPM | 68 | 0 | 68 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 63.373 | £ | 42.705 | JPM | 0 | (430) | (430) | (0,06) |
| 01/2016 | IDR | 9.067.500 | $ | 650 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.346.380 | | 527 | BRC | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.950 | | 1 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.528 | INR | 764.829 | BOA | 31 | (30) | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 136.621 | $ | 2.056 | GLM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 101.851 | | 1.535 | JPM | 0 | | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.758 | INR | 251.482 | JPM | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 240.199 | $ | 3.615 | SCX | 0 | (6) | (6) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | JPY | 140.000 | $ | 1.151 | BPS | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.566.973 | | 86.508 | GLM | 0 | (1.334) | (1.334) | (0,19) |
| 01/2016 | $ | 84.811 | JPY | 10.261.873 | MSB | 495 | 0 | 495 | 0,07 |
| 01/2016 | | 2.493 | | 305.100 | UAG | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| 01/2016 | | 1.066 | KRW | 1.258.306 | BPS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 415 | | 474.926 | BRC | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | | 438 | | 507.861 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.147 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 601.814 | | 524 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.322.481 | | 3.721 | FBF | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 125 | KRW | 141.559 | GLM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 425 | | 481.100 | JPM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.007.184 | $ | 866 | JPM | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.598 | KRW | 1.857.967 | JPM | 5 | (23) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.393.482 | $ | 1.207 | SOG | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 525 | KRW | 604.167 | UAG | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.588 | MYR | 6.558 | AZD | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| 01/2016 | MYR | 4.494 | $ | 1.039 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 28.496 | | 6.507 | HUS | 0 | (98) | (98) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 440 | MYR | 1.848 | JPM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 2.148 | $ | 498 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.579 | MYR | 6.758 | SOG | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.179 | | 4.898 | UAG | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| 01/2016 | NZD | 6.059 | $ | 3.960 | SCX | 0 | (188) | (188) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 1.595 | NZD | 2.374 | UAG | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 37.294 | $ | 553 | JPM | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 527 | RUB | 37.294 | MSB | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 5.790 | $ | 1.947 | JPM | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 35.553 | | 25.812 | JPM | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 146 | AUD | 200 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 5.033 | $ | 1.276 | BPS | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 234 | BRL | 925 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 497 | | 1.954 | DUB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 10.914 | $ | 2.758 | DUB | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 986 | BRL | 3.846 | UAG | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 32.629 | $ | 23.497 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 404 | CAD | 560 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 20.630 | $ | 2.981 | HUS | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | | 17.675 | | 2.567 | MSB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 169.533 | | 186.415 | BOA | 2.121 | 0 | 2.121 | 0,30 |
| 02/2016 | $ | 6.496 | € | 5.940 | CBK | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| 02/2016 | € | 1.561 | $ | 1.708 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.733 | € | 2.500 | HUS | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 2.081 | $ | 2.289 | HUS | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.460 | | 4.895 | JPM | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 889 | € | 813 | JPM | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | | 609 | £ | 400 | BOA | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | | 638 | | 430 | GLM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 42.824 | $ | 63.552 | JPM | 429 | 0 | 429 | 0,06 |
| 02/2016 | IDR | 17.468.490 | | 1.222 | JPM | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.213.515 | | 569 | SCX | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 86.092 | | 1.273 | BRC | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 10.261.873 | | 84.859 | MSB | 0 | (501) | (501) | (0,07) |
| 02/2016 | NOK | 18.445 | | 2.143 | HUS | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| 02/2016 | NZD | 3.685 | | 2.516 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 41.200 | | 4.747 | JPM | 0 | (145) | (145) | (0,02) |
| 02/2016 | SGD | 2.077 | | 1.466 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.365 | | 1.680 | SCX | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 52.885 | | 1.471 | FBF | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 28.818 | | 868 | BRC | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | | 24.130 | | 729 | SOG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 50.633 | | 1.551 | UAG | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 03/2016 | JPY | 900.000 | | 7.407 | BPS | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| 03/2016 | | 6.510.000 | | 53.807 | HUS | 0 | (399) | (399) | (0,06) |
| 03/2016 | $ | 123 | MXN | 2.129 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 68.856 | $ | 4.015 | GLM | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| 04/2016 | BRL | 15.789 | | 4.638 | DUB | 769 | 0 | 769 | 0,11 |
| 04/2016 | DKK | 17.524 | | 2.599 | BOA | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| 04/2016 | | 141.160 | | 20.868 | HUS | 266 | 0 | 266 | 0,04 |
| 04/2016 | | 17.476 | | 2.593 | JPM | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| 04/2016 | RUB | 37.294 | | 514 | MSB | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 16.557 | | 4.742 | CBK | 723 | 0 | 723 | 0,10 |
| 05/2016 | PLN | 11.673 | | 2.885 | GLM | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| 05/2016 | ZAR | 11.715 | | 792 | BOA | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| 07/2016 | DKK | 25.354 | | 3.818 | UAG | 105 | 0 | 105 | 0,01 |
| 09/2016 | CNH | 6.138 | | 929 | BOA | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 09/2016 | | 20.538 | | 3.107 | BPS | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| 09/2016 | | 4.104 | | 617 | BRC | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 09/2016 | | 2.055 | | 309 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 09/2016 | | 2.055 | | 309 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 09/2016 | $ | 1.259 | CNH | 8.214 | JPM | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| 09/2016 | CNH | 38.389 | $ | 5.808 | JPM | 119 | 0 | 119 | 0,02 |
| 09/2016 | $ | 14.143 | CNH | 92.293 | UAG | 0 | (468) | (468) | (0,07) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 09/2016 | CNH | 30.680 | $ | 4.641 | UAG | $ 95 | $ 0 | $ 95 | 0,01 |
| 09/2016 | CZK | 41.062 | | 1.712 | HUS | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 10/2016 | DKK | 43.030 | | 6.577 | JPM | 249 | 0 | 249 | 0,03 |
| | | | | | | $ 10.842 | $ (10.822) | $ 20 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (782)** | **(0,11)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (h)** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (11.500) | $ (12.170) | (1,72) |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | | (5.000) | (5.281) | (0,75) |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | | (25.600) | (27.607) | (3,89) |
| | | | $ (45.058) | (6,36) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (45.058)** | **(6,36)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Credit Suisse** | | | | |
| 0,698 % fällig am 28.01.2016 | $ | 4.800 | $ 4.800 | 0,68 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | | 3.100 | 3.103 | 0,44 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **$ 7.903** | **1,12** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 687.989** | **97,05** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 6 | $ 9 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 27 | 27 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 106.754 | 887 | 0,13 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 756 | 756 | 0,11 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 3.175 | 377 | 0,05 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.054 | 9 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 237 | 15 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 236 | 236 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 44 | 44 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1.103 | 71 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 227 | 227 | 0,03 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 2 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1.377 | 1.496 | 0,21 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 44.963 | 374 | 0,05 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 4.553** | **0,64** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 16.370** | **2,31** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 708.912** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 20.237 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.127 und Barmittel von USD 4.025 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.761 und Barmittel in Höhe von USD 563 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 7.700 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(h) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(i) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.702 | $ 724.800 | $ 973 | $ 730.475 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 7.903 | 0 | 7.903 |
| Finanzderivate[3] | (1.066) | (4.265) | 0 | (5.331) |
| Leerverkäufe | 0 | (45.058) | 0 | (45.058) |
| **Summen** | **$ 3.636** | **$ 683.380** | **$ 973** | **$ 687.989** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 47.301 | $ 748.184 | $ 2.681 | $ 798.166 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 7.910 | 0 | 7.910 |
| Finanzderivate[3] | 1.226 | 8.868 | 0 | 10.094 |
| Leerverkäufe | 0 | (55.850) | 0 | (55.850) |
| **Summen** | **$ 48.527** | **$ 709.112** | **$ 2.681** | **$ 760.320** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

(j) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 6.306 | $ 6.925 | BOA | $ 78 | $ (3) | $ 75 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 5.893 | € 5.527 | BOA | 111 | 0 | 111 | 0,02 |
| 01/2016 | 46 | 42 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 204 | $ 222 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 309 | € 285 | CBK | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 38 | $ 42 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 506 | € 474 | DUB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | 4.242 | 4.004 | GLM | 107 | 0 | 107 | 0,01 |
| 01/2016 | € 6.210 | $ 6.825 | HUS | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 5.883 | € 5.520 | HUS | 114 | 0 | 114 | 0,02 |
| 01/2016 | € 5.449 | $ 5.954 | JPM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 2.326 | € 2.122 | JPM | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | 55 | 52 | NAB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 17 | $ 19 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 323 | € 295 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | 5.901 | 5.552 | UAG | 132 | 0 | 132 | 0,02 |
| 01/2016 | € 5.772 | $ 6.301 | UAG | 34 | (3) | 31 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 7.168 | € 6.519 | BOA | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| 02/2016 | 6.830 | 6.210 | HUS | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| 02/2016 | 5.958 | 5.449 | JPM | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| 02/2016 | $ 6.123 | € 5.602 | UAG | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | | | | $ 701 | $ (261) | $ 440 | 0,06 |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 213 | $ 232 | $ (1) | $ 0 | $ (1) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | (0,163 %) | 13.10.2015 | 12.01.2016 | € 18.580 | $ (20.183) | (2,85) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 7 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(m) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (86) | $ 0 | $ (86) |
| BOA | 496 | (460) | 36 |
| BPS | 289 | (280) | 9 |
| BRC | (275) | 260 | (15) |
| CBK | 1.111 | (1.000) | 111 |
| DUB | 2.611 | (3.610) | (999) |
| FBF | 62 | 0 | 62 |
| GLM | (2.337) | 2.250 | (87) |
| GST | (23) | 210 | 187 |
| HUS | (3.630) | 4.660 | 1.030 |
| JPM | 2.191 | (2.050) | 141 |
| MSB | 7 | 0 | 7 |
| MYC | (362) | 320 | (42) |
| NAB | 1 | 0 | 1 |
| SCX | (82) | 0 | (82) |
| SOG | (150) | 0 | (150) |
| UAG | (166) | 0 | (166) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(n) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 103,04 | 114,29 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,15) | 0,18 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,49) | (0,77) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,11) | 2,04 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (6,36) | (8,00) |
| Summe Einlagenzertifikate | 1,12 | 1,13 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Bond Ex-US Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 42.176.199 | $ | 422.026 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 49.700 | | 68.736 |
| Japan Treasury Bills (0,030)% fällig am 14.03.2016 | JPY | 7.410.000 | | 61.091 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 38.100 | | 47.214 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 26.100 | | 34.556 |
| Spain Government Bond 5,400 % fällig am 31.01.2023 | | 23.700 | | 34.267 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 25.411 | | 25.269 |
| United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 13.500 | | 23.942 |
| Spain Government Bond 2,150 % fällig am 31.10.2025 | € | 16.400 | | 18.604 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 10.125 | | 17.028 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 11.300 | | 15.852 |
| Spain Government Bond 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 11.500 | | 15.003 |
| Federal Home Loan Bank 0,061 % fällig am 29.04.2015 | $ | 14.900 | | 14.899 |
| Realkredit Danmark 2,000 % fällig am 01.04.2016 | DKK | 97.600 | | 14.506 |
| Federal Home Loan Bank 0,067 % fällig am 05.06.2015 | $ | 14.200 | | 14.198 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,750 % fällig am 01.08.2023 | € | 10.300 | | 14.040 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,500 % fällig am 01.12.2024 | | 10.900 | | 13.742 |
| Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.12.2044 | JPY | 1.550.000 | | 13.667 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 34.200 | | 10.267 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | | 35.500 | | 9.408 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 46.892.677 | $ | 469.200 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 52.400 | | 71.797 |
| Spain Government Bond 5,400 % fällig am 31.01.2023 | | 47.400 | | 68.363 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | | 43.300 | | 53.478 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 32.300 | | 42.709 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,750 % fällig am 01.08.2023 | | 20.600 | | 28.223 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.05.2023 | | 18.500 | | 24.890 |
| United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 12.600 | | 22.285 |
| Japan Government International Bond 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 2.080.000 | | 18.258 |
| Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 58.150 | | 16.163 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 11.300 | | 15.499 |
| Federal Home Loan Bank 0,061 % fällig am 29.04.2015 | $ | 14.900 | | 14.900 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 58.600 | | 14.881 |
| Federal Home Loan Bank 0,067 % fällig am 05.06.2015 | $ | 14.200 | | 14.198 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,500 % fällig am 01.12.2024 | € | 10.900 | | 13.243 |
| Japan Government International Bond 1,700 % fällig am 20.09.2044 | JPY | 1.420.000 | | 12.987 |
| Spain Government Bond 5,150 % fällig am 31.10.2044 | € | 7.050 | | 11.067 |
| Japan Government International Bond 1,500 % fällig am 20.12.2044 | JPY | 1.280.000 | | 10.833 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 35.500 | | 8.650 |
| Federal Home Loan Bank 0,064 % fällig am 12.06.2015 | | $ 8.600 | | 8.599 |

(a) Der Global Bond Ex-US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Global Dividend Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000$) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 135.501 | $ 1.355 | 1,96 |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | |
| G8 Education Ltd. | 280.679 | 725 | 1,05 |
| Sonic Healthcare Ltd. | 52.864 | 683 | 0,99 |
| Spotless Group Holdings Ltd. | 1.009.843 | 790 | 1,14 |
| | | 2.198 | 3,18 |
| **BRASILIEN** | | | |
| Arteris S.A. | 276.123 | 673 | 0,98 |
| Light S.A. | 150.563 | 376 | 0,54 |
| Qualicorp S.A. | 102.834 | 366 | 0,53 |
| | | 1.415 | 2,05 |
| **KANADA** | | | |
| Capital Power Corp. | 80.768 | 1.033 | 1,49 |
| **FRANKREICH** | | | |
| Carrefour S.A. | 34.576 | 997 | 1,44 |
| Engie S.A. | 77.067 | 1.365 | 1,98 |
| | | 2.362 | 3,42 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| Covestro AG | 18.040 | 659 | 0,95 |
| **GRIECHENLAND** | | | |
| OPAP S.A. | 96.545 | 847 | 1,22 |
| **HONGKONG** | | | |
| China Mobile Ltd. | 147.312 | 1.658 | 2,40 |
| **ITALIEN** | | | |
| Intesa Sanpaolo SpA | 498.822 | 1.656 | 2,40 |
| Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA | 61.369 | 652 | 0,94 |
| | | 2.308 | 3,34 |
| **JAPAN** | | | |
| Bridgestone Corp. | 28.281 | 969 | 1,40 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 34.396 | 1.368 | 1,98 |
| | | 2.337 | 3,38 |
| **MEXIKO** | | | |
| Coca-Cola Femsa SAB de C.V. | 47.104 | 336 | 0,49 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| Aegon NV | 362.794 | $ 2.051 | 2,97 |
| NN Group NV | 19.297 | 680 | 0,98 |
| | | 2.731 | 3,95 |
| **RUSSLAND** | | | |
| Magnit PJSC | 7.399 | 298 | 0,43 |
| **SPANIEN** | | | |
| Ebro Foods S.A. | 52.320 | 1.029 | 1,49 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| Roche Holding AG | 4.955 | 1.374 | 1,99 |
| **TAIWAN** | | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 232.677 | 1.004 | 1,45 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Imperial Tobacco Group PLC | 12.983 | 686 | 0,99 |
| **ENERGY** | | | |
| Golar LNG Partners LP | 62.247 | 833 | 1,21 |
| **FINANCIALS** | | | |
| HSBC Holdings PLC | 254.019 | 2.005 | 2,90 |
| ICAP PLC | 133.809 | 1.004 | 1,45 |
| Lloyds Banking Group PLC | 1.870.315 | 2.012 | 2,91 |
| | | 5.021 | 7,26 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Vodafone Group PLC | 744.719 | 2.414 | 3,49 |
| Summe Großbritannien | | 8.954 | 12,95 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Comcast Corp. | 29.829 | 1.683 | 2,43 |
| General Motors Co. | 49.399 | 1.680 | 2,43 |
| Kohl's Corp. | 14.506 | 691 | 1,00 |
| Macy's, Inc. | 19.269 | 674 | 0,98 |
| SeaWorld Entertainment, Inc. | 35.926 | 707 | 1,02 |
| Time Warner, Inc. | 10.618 | 687 | 0,99 |
| | | 6.122 | 8,85 |
| **ENERGY** | | | |
| Schlumberger Ltd. | 19.932 | 1.390 | 2,01 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Blackstone Group LP | 56.680 | 1.657 | 2,40 |
| Navient Corp. | 56.299 | 645 | 0,93 |
| Outfront Media, Inc. | 30.366 | $ 663 | 0,96 |
| Prudential Financial, Inc. | 16.564 | 1.348 | 1,95 |
| Regions Financial Corp. | 105.618 | 1.014 | 1,46 |
| | | 5.327 | 7,70 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AbbVie, Inc. | 29.237 | 1.732 | 2,50 |
| Merck & Co., Inc. | 25.991 | 1.373 | 1,99 |
| Pfizer, Inc. | 62.878 | 2.030 | 2,94 |
| | | 5.135 | 7,43 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Nielsen Holdings PLC | 29.425 | 1.371 | 1,98 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Apple, Inc. | 15.821 | 1.666 | 2,41 |
| Cisco Systems, Inc. | 62.426 | 1.695 | 2,45 |
| QUALCOMM, Inc. | 41.394 | 2.069 | 2,99 |
| Symantec Corp. | 49.809 | 1.046 | 1,52 |
| Western Digital Corp. | 34.204 | 2.054 | 2,97 |
| | | 8.530 | 12,34 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| International Paper Co. | 39.935 | 1.505 | 2,18 |
| Steel Dynamics, Inc. | 39.663 | 709 | 1,02 |
| | | 2.214 | 3,20 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 59.919 | 2.062 | 2,98 |
| CenturyLink, Inc. | 26.895 | 677 | 0,98 |
| | | 2.739 | 3,96 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| PG&E Corp. | 38.026 | 2.023 | 2,93 |
| Summe USA | | 34.851 | 50,40 |
| Summe Stammaktien | | 65.394 | 94,58 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Colony Capital, Inc. | 67.360 | 1.312 | 1,90 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 68.061** | **98,44** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL 386 | $ 97 | MSC | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 10.287 | 11.084 | BOA | 45 | (135) | (90) | (0,13) |
| 01/2016 | $ 10 | € 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 3.913 | 3.581 | CBK | 0 | (23) | (23) | (0,03) |
| 01/2016 | 19 | 17 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 46 | 43 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 7.324 | 6.706 | UAG | 0 | (40) | (40) | (0,06) |
| 01/2016 | 4.621 | £ 3.114 | CBK | 0 | (31) | (31) | (0,05) |
| 01/2016 | £ 3.114 | $ 4.695 | MSB | 105 | 0 | 105 | 0,15 |
| 02/2016 | $ 3.938 | € 3.581 | BOA | 0 | (45) | (45) | (0,07) |
| 02/2016 | € 6.706 | $ 7.330 | UAG | 40 | 0 | 40 | 0,06 |
| 02/2016 | £ 3.114 | 4.621 | CBK | 31 | 0 | 31 | 0,05 |
| | | | | $ 221 | $ (274) | $ (53) | (0,08) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (53)** | **(0,08)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 68.008** | **98,36** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 28 | $ 42 | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | 12 | 0,02 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.501 | 12 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 331 | 331 | 0,48 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 15 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 103 | 103 | 0,15 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 100 | 100 | 0,14 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 1 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 9 | 13 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 632 | 5 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 628** | **0,91** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 505** | **0,73** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 69.141** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(b) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 41.052 | $ 27.009 | $ 0 | $ 68.061 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (53) | 0 | (53) |
| **Summen** | **$ 41.052** | **$ 26.956** | **$ 0** | **$ 68.008** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 47.151 | $ 37.347 | $ 0 | $ 84.498 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 329 | 0 | 329 |
| **Summen** | **$ 47.151** | **$ 37.676** | **$ 0** | **$ 84.827** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO Global Dividend Fund (Forts.)

**(c) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 63 | AUD | 87 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.427 | | 1.965 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 14 | $ | 10 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4 | AUD | 6 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.075 | $ | 1.493 | NAB | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| 01/2016 | | 10 | | 7 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10 | AUD | 14 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14 | | 19 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 21 | | 29 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 16 | $ | 11 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 417 | BRL | 1.633 | DUB | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 1.633 | $ | 432 | DUB | 20 | 0 | 20 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 22 | CAD | 30 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 17 | $ | 12 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.495 | CAD | 2.073 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 14 | $ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | | 2 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 350 | CAD | 487 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 2.570 | $ | 1.931 | MSB | 81 | 0 | 81 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 11 | CAD | 15 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 11 | $ | 8 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12 | CAD | 17 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 19 | CHF | 19 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 2.092 | $ | 2.038 | BOA | 0 | (52) | (52) | (0,08) |
| 01/2016 | | 16 | | 16 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 27 | CHF | 27 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4 | | 4 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 67 | | 69 | FBF | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.040 | | 2.020 | MSB | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| 01/2016 | CHF | 18 | $ | 18 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 18 | CHF | 18 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 12 | $ | 12 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 1.867 | | 266 | SCX | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 16.806 | € | 15.763 | BOA | 317 | 0 | 317 | 0,46 |
| 01/2016 | € | 12.038 | $ | 13.227 | BOA | 150 | (1) | 149 | 0,22 |
| 01/2016 | | 615 | | 673 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 374 | | 406 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.508 | | 25.694 | CBK | 183 | (25) | 158 | 0,23 |
| 01/2016 | $ | 17.199 | € | 16.211 | CBK | 415 | (4) | 411 | 0,60 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 270 | | 287 | NAB | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | | 177 | | 193 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 129 | € | 119 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.709 | | 7.280 | SOG | 199 | 0 | 199 | 0,29 |
| 01/2016 | € | 3.765 | $ | 4.111 | SOG | 22 | 0 | 22 | 0,03 |
| 01/2016 | | 14.885 | | 16.254 | UAG | 89 | (5) | 84 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 16.685 | € | 15.701 | UAG | 370 | 0 | 370 | 0,53 |
| 01/2016 | | 42 | £ | 28 | AZD | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 81 | | 54 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 53 | $ | 80 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 83 | £ | 55 | BPS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 941 | | 631 | CBK | 0 | (10) | (10) | (0,02) |
| 01/2016 | | 8 | | 5 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.399 | | 2.296 | MSB | 0 | (15) | (15) | (0,02) |
| 01/2016 | £ | 3.038 | $ | 4.580 | MSB | 102 | 0 | 102 | 0,15 |
| 01/2016 | | 17 | | 25 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 39 | £ | 26 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 34 | | 23 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | HKD | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | HKD | 57 | $ | 7 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11 | HKD | 85 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 95 | INR | 6.315 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 18 | JPY | 2.180 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 647.647 | $ | 5.278 | BOA | 0 | (106) | (106) | (0,15) |
| 01/2016 | $ | 393 | JPY | 47.246 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6 | | 712 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 540 | $ | 4 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | JPY | 125 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.315 | | 643.086 | MSB | 31 | 0 | 31 | 0,04 |
| 01/2016 | JPY | 356 | $ | 3 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4 | JPY | 533 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 460 | $ | 4 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 17 | JPY | 2.120 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.144.276 | $ | 979 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 179 | KRW | 210.276 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 813 | $ | 185 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 1.028 | | 119 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 3.431 | | 73 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 183 | RUB | 12.928 | MSB | $ 0 | $ (6) | $ (6) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 12.928 | $ | 196 | SOG | 20 | 0 | 20 | 0,03 |
| 01/2016 | SEK | 5.607 | | 643 | BOA | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 549 | SEK | 4.579 | CBK | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | | 122 | | 1.028 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 150 | $ | 51 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3 | AUD | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.585 | $ | 1.151 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 82 | BRL | 334 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 1.633 | $ | 413 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 02/2016 | CAD | 1.978 | | 1.425 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3 | CAD | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4 | CHF | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 1.588 | $ | 1.605 | MSB | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 13.204 | € | 12.008 | BOA | 0 | (150) | (150) | (0,22) |
| 02/2016 | € | 42 | $ | 46 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 13.259 | € | 12.121 | CBK | 0 | (83) | (83) | (0,12) |
| 02/2016 | | 4.114 | | 3.765 | SOG | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| 02/2016 | | 15.651 | | 14.318 | UAG | 0 | (86) | (86) | (0,12) |
| 02/2016 | £ | 2.296 | $ | 3.399 | MSB | 15 | 0 | 15 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 9 | £ | 6 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2 | HKD | 17 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 84 | | 653 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 423 | | 3.276 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 86 | $ | 11 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 16.983 | | 2.192 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 1.919.045 | | 137 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 450 | | 116 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 34.366 | | 515 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | JPY | 128 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 987 | | 119.248 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 643.086 | $ | 5.318 | MSB | 0 | (31) | (31) | (0,05) |
| 02/2016 | SEK | 4.579 | | 550 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 02/2016 | SGD | 437 | | 310 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 144 | TWD | 4.742 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 24.823 | $ | 763 | UAG | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 03/2016 | MXN | 6.483 | | 371 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 04/2016 | CLP | 27.615 | | 39 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 12.928 | | 178 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 05/2016 | PLN | 332 | | 82 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 5.692 | | 385 | BOA | 26 | 0 | 26 | 0,04 |
| | | | | | | $ 2.114 | $ (695) | $ 1.419 | 2,05 |

**(d) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BOA | 25 | 0 | 25 |
| BPS | 4 | 0 | 4 |
| CBK | 457 | (370) | 87 |
| DUB | 28 | 0 | 28 |
| FBF | 2 | 0 | 2 |
| MSB | 283 | 0 | 283 |
| NAB | (23) | 0 | (23) |
| SCX | (5) | 0 | (5) |
| SOG | 219 | (290) | (71) |
| UAG | 377 | (360) | 17 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(e) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,44 | 98,87 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,08) | 0,38 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO Global Dividend Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 6.216.905 | $ 62.206 |
| Carrefour S.A. | 113.943 | 3.651 |
| AT&T, Inc. | 102.608 | 3.574 |
| HSBC Holdings PLC | 308.186 | 2.487 |
| E.ON SE | 159.794 | 2.444 |
| Capital Power Corp. | 122.975 | 2.423 |
| AbbVie, Inc. | 39.202 | 2.404 |
| Colony Capital, Inc. | 100.347 | 2.392 |
| PG&E Corp. | 44.385 | 2.352 |
| Regions Financial Corp. | 201.063 | 2.092 |
| Merck & Co., Inc. | 35.196 | 2.078 |
| Engie S.A. | 105.826 | 2.044 |
| Western Digital Corp. | 26.278 | 2.033 |
| Targa Resources Corp. | 23.481 | 2.024 |
| Comcast Corp. | 33.658 | 2.011 |
| Aegon NV | 286.615 | 2.004 |
| Apple, Inc. | 17.359 | 1.999 |
| Blackstone Group LP | 49.380 | 1.958 |
| Lloyds Banking Group PLC | 1.525.915 | 1.956 |
| Navient Corp. | 122.810 | 1.926 |
| QUALCOMM, Inc. | 30.524 | 1.758 |
| Schlumberger Ltd. | 22.339 | 1.732 |
| Nielsen Holdings PLC | 35.164 | 1.671 |
| Bridgestone Corp. | 42.795 | 1.600 |
| Steel Dynamics, Inc. | 77.947 | 1.571 |
| NN Group NV | 53.196 | 1.520 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 6.093.315 | $ 60.970 |
| Target Corp. | 39.511 | 3.153 |
| JPMorgan Chase & Co. | 43.960 | 2.993 |
| PG&E Corp. | 55.089 | 2.929 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 815.927 | 2.766 |
| Carrefour S.A. | 79.367 | 2.616 |
| Colony Capital, Inc. | 121.742 | 2.511 |
| Bridgestone Corp. | 62.814 | 2.302 |
| ONE Gas, Inc. | 51.456 | 2.286 |
| Steel Dynamics, Inc. | 126.657 | 2.260 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 43.710 | 2.255 |
| Suez Environnement Co. | 113.461 | 2.149 |
| E.ON SE | 159.794 | 2.136 |
| Lloyds Banking Group PLC | 1.856.746 | 2.123 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 45.004 | 2.037 |
| ITV PLC | 543.878 | 1.975 |
| Li & Fung Ltd. | 2.740.000 | 1.973 |
| Kohl's Corp. | 38.067 | 1.963 |
| Navient Corp. | 144.643 | 1.929 |
| Corning, Inc. | 74.810 | 1.844 |
| Electricite de France S.A. | 92.810 | 1.811 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 22.722 | 1.811 |
| Total S.A. | 32.854 | 1.758 |
| Prudential Financial, Inc. | 19.527 | 1.667 |
| Timken Co. | 41.792 | 1.653 |
| Blackstone Group LP | 43.552 | 1.547 |

(a) Der PIMCO Global Dividend Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2022 | $ | 3.033 | $ 1.881 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 01.11.2019 | | 2.000 | 1.595 | 0,04 |
| **Nufarm Australia Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.10.2019 | | 5.700 | 5.664 | 0,15 |
| | | | 9.140 | 0,24 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Groep NV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.03.2049 | € | 6.000 | 6.534 | 0,17 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| **Digicel Group Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2022 | $ | 7.000 | 5.285 | 0,14 |
| 8,250 % fällig am 30.09.2020 | | 6.000 | 4.980 | 0,13 |
| **Digicel Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | | 5.000 | 4.237 | 0,11 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2020 | | 4.000 | 3.660 | 0,09 |
| | | | 18.162 | 0,47 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 750 | 540 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 27.01.2041 | | 1.000 | 645 | 0,02 |
| | | | 1.185 | 0,03 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | | 7.000 | 6.790 | 0,18 |
| **KANADA** | | | | |
| **Baytex Energy Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.06.2021 | | 2.500 | 1.694 | 0,04 |
| 5,625 % fällig am 01.06.2024 | | 3.750 | 2.531 | 0,07 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2018 | | 2.500 | 2.306 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 6.000 | 4.230 | 0,11 |
| **Entertainment One Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.12.2022 | £ | 3.750 | 5.527 | 0,14 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2020 | $ | 4.852 | 3.154 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2021 | | 4.500 | 2.846 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 3.500 | 2.205 | 0,06 |
| **Masonite International Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 5.187 | 0,13 |
| **New Red Finance, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.04.2022 | | 10.000 | 10.325 | 0,27 |
| **Novelis, Inc.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.12.2017 | | 6.000 | 5.865 | 0,15 |
| 8,750 % fällig am 15.12.2020 | | 6.500 | 5.996 | 0,15 |
| **Precision Drilling Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.11.2020 | | 4.000 | 3.140 | 0,08 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 8.250 | 7.823 | 0,20 |
| 5,625 % fällig am 01.12.2021 | $ | 14.000 | 12.950 | 0,34 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | 4.488 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 12.750 | 11.411 | 0,30 |
| 7,500 % fällig am 15.07.2021 | | 1.000 | 1.003 | 0,03 |
| **Videotron Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2022 | | 6.000 | 6.023 | 0,16 |
| | | | 98.704 | 2,56 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Brakes Capital** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.12.2018 | £ | 6.000 | 9.131 | 0,24 |
| **MCE Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | $ | 8.000 | 7.320 | 0,19 |
| **UPCB Finance IV Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | | 7.000 | 6.632 | 0,17 |
| **UPCB Finance V Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.11.2021 | $ | 1.800 | $ 1.919 | 0,05 |
| **UPCB Finance VI Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2022 | | 3.600 | 3.821 | 0,10 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 10.000 | 8.850 | 0,23 |
| | | | 37.673 | 0,98 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Welltec** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.02.2019 | | 5.800 | 5.467 | 0,14 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **Paroc Group Oy** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2020 | € | 2.000 | 2.094 | 0,05 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **3AB Optique Developpement SAS** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2019 | | 2.000 | 1.966 | 0,05 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 8.300 | 8.528 | 0,22 |
| **CMA CGM S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.01.2021 | € | 2.200 | 2.102 | 0,06 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 7.150 | 8.000 | 0,21 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 4.250 | 6.174 | 0,16 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 17.650 | 18.104 | 0,47 |
| **Dry Mix Solutions Investissements SAS** | | | | |
| 4,122 % fällig am 15.06.2021 | € | 2.000 | 2.129 | 0,06 |
| **Horizon Holdings I SASU** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.08.2023 | | 2.400 | 2.711 | 0,07 |
| **Horizon Holdings III SASU** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2022 | | 2.175 | 2.446 | 0,06 |
| **Lion** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.04.2019 | | 2.750 | 2.435 | 0,06 |
| **Novasep Holding SAS** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2016 | $ | 1.521 | 1.487 | 0,04 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | | 1.000 | 994 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 6.000 | 6.624 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 16.000 | 15.560 | 0,40 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | | 13.175 | 12.747 | 0,33 |
| **SGD Group SAS** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2019 | € | 1.500 | 1.672 | 0,04 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | $ | 15.000 | 14.982 | 0,39 |
| **SPCM S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2022 | | 6.250 | 6.390 | 0,17 |
| | | | 115.051 | 2,99 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **CeramTec Group GmbH** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.08.2021 | € | 12.550 | 14.709 | 0,38 |
| **Deutsche Raststaetten Gruppe IV GmbH** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.12.2020 | | 6.000 | 6.964 | 0,18 |
| **Douglas GmbH** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.07.2022 | | 4.000 | 4.577 | 0,12 |
| **Kirk Beauty One GmbH** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.07.2023 | | 4.750 | 5.322 | 0,14 |
| **Paternoster Holding III GmbH** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2023 | | 7.500 | 7.740 | 0,20 |
| **Pfleiderer GmbH** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.08.2019 | | 12.000 | 13.626 | 0,35 |
| **ProGroup AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2022 | | 1.500 | 1.714 | 0,05 |
| **Safari Holding Verwaltungs GmbH** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.02.2021 | | 2.100 | 2.412 | 0,06 |
| **Techem Energy Metering Service GmbH & Co. KG** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.10.2020 | | 3.000 | 3.505 | 0,09 |
| **Techem GmbH** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.10.2019 | | 2.000 | 2.284 | 0,06 |
| **Unitymedia GmbH** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2027 | | 5.000 | 4.689 | 0,12 |
| 6,125 % fällig am 15.01.2025 | $ | 6.000 | 5.951 | 0,15 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2025 | € | 2.000 | $ 2.099 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2026 | | 3.750 | 4.069 | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2025 | $ | 4.000 | 3.835 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2022 | € | 2.700 | 3.116 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | $ | 2.500 | 2.503 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2023 | € | 8.100 | 9.371 | 0,24 |
| | | | 98.486 | 2,56 |
| **IRLAND** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.05.2019 | $ | 2.000 | 2.002 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 10.000 | 10.188 | 0,27 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 5.000 | 5.131 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 2.000 | 2.065 | 0,05 |
| **Ardagh Packaging Finance PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.11.2020 | | 1.235 | 1.220 | 0,03 |
| **Endo Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2023 | | 10.000 | 10.000 | 0,26 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2025 | | 7.500 | 7.425 | 0,19 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.04.2022 | | 9.000 | 9.068 | 0,24 |
| **Smurfit Kappa Treasury Funding Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 20.11.2025 | | 350 | 405 | 0,01 |
| | | | 47.504 | 1,23 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Cooperativa Muratori & Cementisti-CMC di Ravenna SC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.08.2021 | € | 6.675 | 6.276 | 0,16 |
| **Guala Closures SpA** | | | | |
| 5,294 % fällig am 15.11.2019 | | 2.300 | 2.505 | 0,07 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 5.250 | 5.174 | 0,13 |
| 7,700 % fällig am 29.12.2049 | | 5.000 | 5.102 | 0,13 |
| **Marcolin SpA** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.11.2019 | € | 5.000 | 5.562 | 0,15 |
| **TeamSystem Holding SpA** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | | 3.000 | 3.390 | 0,09 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 5,303 % fällig am 30.05.2024 | $ | 30.000 | 29.738 | 0,77 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 7.000 | 7.184 | 0,19 |
| 8,000 % fällig am 03.04.2049 | $ | 15.000 | 14.235 | 0,37 |
| **Zobele Holding SpA** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2018 | € | 4.000 | 4.405 | 0,11 |
| | | | 83.571 | 2,17 |
| **JAPAN** | | | | |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2020 | $ | 5.000 | 4.987 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 30.07.2025 | € | 2.000 | 2.114 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 30.07.2027 | | 1.500 | 1.587 | 0,04 |
| | | | 8.688 | 0,22 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.07.2022 | £ | 5.000 | 7.029 | 0,18 |
| **Mercury Bondco PLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.05.2021 (a) | € | 8.000 | 8.689 | 0,23 |
| | | | 15.718 | 0,41 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Accudyne Industries Borrower** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2020 | $ | 10.000 | 7.250 | 0,19 |
| **Aguila 3 S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 31.01.2018 | CHF | 7.250 | 7.425 | 0,19 |
| 7,875 % fällig am 31.01.2018 | $ | 5.000 | 5.031 | 0,13 |
| **Albea Beauty Holdings S.A.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.11.2019 | | 5.000 | 5.225 | 0,14 |
| 8,750 % fällig am 01.11.2019 | € | 2.750 | 3.187 | 0,08 |
| **Aldesa Financial Services S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.04.2021 | | 4.400 | 3.776 | 0,10 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | $ | 3.500 | 3.474 | 0,09 |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 14.000 | 13.860 | 0,36 |
| 7,875 % fällig am 15.12.2019 | | 3.000 | 3.127 | 0,08 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.01.2024 | $ | 3.250 | $ 3.152 | 0,08 |
| 9,875 % fällig am 15.12.2020 | | 4.000 | 4.270 | 0,11 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | € | 6.000 | 5.524 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 10.000 | 10.202 | 0,26 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | $ | 4.250 | 3.676 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 7.000 | 6.335 | 0,16 |
| **Auris Luxembourg II S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.01.2023 | € | 6.250 | 7.426 | 0,19 |
| **Cabot Financial Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.04.2021 | £ | 5.000 | 7.134 | 0,19 |
| **Capsugel S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2019 (a) | $ | 6.000 | 5.861 | 0,15 |
| **Cerberus Nightingale 1 SARL** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.02.2020 | € | 3.000 | 3.359 | 0,09 |
| **CHC Helicopter S.A.** | | | | |
| 9,250 % fällig am 15.10.2020 | $ | 6.120 | 2.968 | 0,08 |
| **ConvaTec Finance International S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.01.2019 (a) | | 11.500 | 10.738 | 0,28 |
| **ConvaTec Healthcare E S.A.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 15.12.2018 | | 2.000 | 2.021 | 0,05 |
| 10,875 % fällig am 15.12.2018 | € | 5.750 | 6.435 | 0,17 |
| **Dufry Finance S.C.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2023 | | 1.750 | 2.001 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.10.2020 | $ | 3.500 | 3.657 | 0,10 |
| **Elior Finance & Co. S.C.A** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2020 | € | 358 | 414 | 0,01 |
| **Galapagos Holding S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.06.2022 | | 4.000 | 3.803 | 0,10 |
| **Galapagos S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.06.2021 | | 3.600 | 3.801 | 0,10 |
| **GCS Holdco Finance I S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2018 | | 2.000 | 2.255 | 0,06 |
| **INEOS Group Holdings S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.02.2019 | $ | 1.000 | 974 | 0,03 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | | 10.000 | 7.900 | 0,21 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2022 | | 5.000 | 3.213 | 0,08 |
| 7,250 % fällig am 15.10.2020 | | 4.000 | 3.520 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2021 | | 1.625 | 1.422 | 0,04 |
| **Intelsat Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.06.2021 | | 7.000 | 3.308 | 0,09 |
| 8,125 % fällig am 01.06.2023 | | 4.000 | 1.830 | 0,05 |
| **LSF9 Balta Issuer S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.09.2022 | € | 3.750 | 4.283 | 0,11 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.04.2023 | $ | 11.000 | 9.790 | 0,25 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2025 | | 3.500 | 3.238 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2023 | | 1.000 | 955 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 01.08.2022 | | 12.000 | 11.580 | 0,30 |
| **Millicom International Cellular S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.10.2021 | | 6.750 | 6.269 | 0,16 |
| **Monitchem HoldCo 2 S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.06.2022 | € | 6.100 | 5.954 | 0,15 |
| **Monitchem HoldCo 3 S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.06.2021 | | 2.250 | 2.438 | 0,06 |
| **Pacific Drilling S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.06.2020 | $ | 1.500 | 630 | 0,02 |
| **SIG Combibloc Holdings SCA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 14.400 | 16.385 | 0,43 |
| **Swissport Investments S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2021 | | 3.600 | 4.077 | 0,11 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | $ | 5.000 | 4.800 | 0,12 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | | 2.000 | 2.030 | 0,05 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2020 | | 16.750 | 16.624 | 0,43 |
| 7,000 % fällig am 23.04.2021 | € | 8.850 | 9.542 | 0,25 |
| 7,375 % fällig am 23.04.2021 | $ | 1.500 | 1.421 | 0,04 |
| | | | 269.570 | 7,00 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Constellium NV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2021 | € | 3.000 | 2.530 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | $ | 1.000 | 685 | 0,02 |
| **Darling Global Finance BV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.05.2022 | € | 6.000 | $ 6.332 | 0,16 |
| **Dutch Lion BV** | | | | |
| 11,250 % fällig am 15.06.2020 (a) | | 6.546 | 1.138 | 0,03 |
| **Fiat Chrysler Automobiles NV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | $ | 7.000 | 6.912 | 0,18 |
| **Goodyear Dunlop Tires Europe BV** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.04.2019 | € | 585 | 658 | 0,02 |
| **Hema Bondco I BV** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.06.2019 | | 4.000 | 3.270 | 0,08 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.500 | 1.507 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.000 | 982 | 0,02 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2020 | | 3.500 | 3.509 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 15.03.2023 | | 2.500 | 2.587 | 0,07 |
| **PortAventura Entertainment Barcelona BV** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.12.2020 | € | 4.000 | 4.475 | 0,12 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | | 7.900 | 8.367 | 0,22 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2021 | $ | 3.500 | 3.491 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2021 | | 8.250 | 8.332 | 0,22 |
| **Schaeffler Holding Finance BV (a)** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.11.2021 | € | 2.650 | 3.092 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 15.11.2019 | $ | 6.000 | 6.292 | 0,16 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 | | 10.000 | 10.800 | 0,28 |
| 6,875 % fällig am 15.08.2018 | € | 10.800 | 12.169 | 0,32 |
| **Sensata Technologies BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2023 | $ | 6.000 | 5.858 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | | 3.500 | 3.430 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 01.11.2024 | | 2.500 | 2.566 | 0,07 |
| **UPC Holding BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.09.2022 | € | 4.000 | 4.631 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2023 | CHF | 6.500 | 7.027 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2023 | € | 6.600 | 7.752 | 0,20 |
| **VTR Finance BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2024 | $ | 5.000 | 4.613 | 0,12 |
| **Ziggo Bond Finance BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2025 | | 6.000 | 5.588 | 0,14 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | € | 2.750 | 2.773 | 0,07 |
| | | | 131.366 | 3,41 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **Lock** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2021 | | 10.000 | 11.380 | 0,29 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 4.600 | 4.898 | 0,13 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 10.000 | 10.685 | 0,28 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 4.000 | 4.296 | 0,11 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | € | 5.000 | 5.120 | 0,13 |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | | 10.000 | 11.841 | 0,31 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 12.03.2049 | | 5.000 | 5.149 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 8.000 | 8.152 | 0,21 |
| | | | 50.141 | 1,30 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 4.850 | 4.754 | 0,13 |
| **Perstorp Holding AB** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.05.2017 | € | 5.000 | 5.492 | 0,14 |
| 11,000 % fällig am 15.08.2017 | $ | 5.000 | 4.725 | 0,12 |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.11.2049 | | 4.600 | 4.537 | 0,12 |
| **Verisure Holding AB** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2022 | € | 8.500 | 9.636 | 0,25 |
| | | | 29.144 | 0,76 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.000 | 5.012 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 5.000 | 5.271 | 0,14 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 3.500 | $ 3.998 | 0,10 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.000 | 2.120 | 0,05 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | | 2.500 | 2.625 | 0,07 |
| | | | 19.026 | 0,49 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Afren PLC** | | | | |
| 10,250 % fällig am 08.04.2019 (b) | | 9.758 | 197 | 0,00 |
| 15,000 % fällig am 25.04.2016 (f) | | 5.700 | 2.337 | 0,06 |
| **Algeco Scotsman Global Finance PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.10.2018 | | 7.750 | 6.529 | 0,17 |
| **Arqiva Broadcast Finance PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 31.03.2020 | £ | 8.750 | 13.996 | 0,36 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 6.200 | 6.839 | 0,18 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 5.600 | 8.270 | 0,21 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 7.500 | 8.857 | 0,23 |
| **BIBBY Offshore Services PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.06.2021 | £ | 3.500 | 3.740 | 0,10 |
| **Boparan Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.07.2021 | | 2.000 | 2.624 | 0,07 |
| **Coventry Building Society** | | | | |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | | 3.400 | 4.857 | 0,13 |
| **Ephios Bondco PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.07.2022 | € | 5.500 | 6.227 | 0,16 |
| **GHD Bondco PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.04.2020 | £ | 6.000 | 8.070 | 0,21 |
| **Ineos Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.05.2023 | € | 7.400 | 7.707 | 0,20 |
| **International Game Technology PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2022 | $ | 8.250 | 7.755 | 0,20 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2025 | | 6.000 | 5.295 | 0,14 |
| **Jaguar Land Rover Automotive PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.12.2018 | | 1.750 | 1.765 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2023 | | 5.000 | 5.069 | 0,13 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.06.2049 | € | 3.000 | 3.446 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | £ | 8.079 | 12.131 | 0,31 |
| 7,500 % fällig am 30.04.2049 | $ | 3.000 | 3.202 | 0,08 |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 20.000 | 30.947 | 0,80 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 6,875 % fällig am 11.03.2049 | | 3.000 | 4.450 | 0,12 |
| | | **AKTIEN** | | |
| 10,250 % fällig am 29.06.2049 | | 27.380 | 5.228 | 0,14 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **New Look Secured Issuer PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.07.2022 | $ | 6.000 | 8.800 | 0,23 |
| **NWEN Finance PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 21.06.2021 | | 3.250 | 5.037 | 0,13 |
| **Pendragon PLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | | 4.700 | 7.274 | 0,19 |
| **Pizzaexpress Financing 2 PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2021 | | 5.000 | 7.577 | 0,20 |
| **Premier Foods Finance PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2021 | | 8.500 | 11.993 | 0,31 |
| **R&R Ice Cream PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.05.2020 | | 1.500 | 2.286 | 0,06 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 10.000 | 10.437 | 0,27 |
| 7,648 % fällig am 29.08.2049 | | 7.750 | 9.639 | 0,25 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.100 | 2.226 | 0,06 |
| | | **AKTIEN** | | |
| 9,118 % fällig am 29.03.2049 | | 750.000 | 757 | 0,02 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 4.125 | 6.191 | 0,16 |
| **Sensata Technologies UK Financing Co. PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | $ | 5.000 | 5.212 | 0,14 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 2.000 | 1.940 | 0,05 |
| **TES Finance PLC** | | | | |
| 5,583 % fällig am 15.07.2020 | £ | 2.000 | 2.854 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.07.2020 | | 4.250 | 6.013 | 0,16 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 3.668 | $ 5.097 | 0,13 |
| **Tullow Oil PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2020 | $ | 7.500 | 5.250 | 0,14 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 5.000 | 4.825 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | | 6.250 | 6.258 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 15.04.2023 | | 2.000 | 2.037 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 15.10.2024 | £ | 2.000 | 2.985 | 0,08 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | $ | 7.500 | 7.312 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | £ | 1.500 | 2.355 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | | 4.500 | 6.882 | 0,18 |
| 6,250 % fällig am 28.03.2029 | | 2.750 | 4.089 | 0,11 |
| | | | 294.864 | 7,66 |

## USA

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **Groupe Novasep SAS (f)** | 321.100 | 698 | 0,02 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2021 | $ | 2.750 | 2.887 | 0,07 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2023 | | 5.000 | 5.312 | 0,14 |
| **ADT Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 15.000 | 13.500 | 0,35 |
| 4,125 % fällig am 15.06.2023 | | 8.000 | 7.520 | 0,20 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2042 | | 4.000 | 2.880 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2021 | | 3.000 | 3.149 | 0,08 |
| **AECOM** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2022 | | 2.000 | 2.067 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.10.2024 | | 4.000 | 4.095 | 0,11 |
| **AES Corp.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.07.2021 | | 6.000 | 6.150 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 01.06.2020 | | 3.500 | 3.867 | 0,10 |
| **Alcoa, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2024 | | 4.000 | 3.660 | 0,09 |
| **Alere, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.07.2018 | | 2.000 | 2.052 | 0,05 |
| **Aleris International, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2018 | | 4.000 | 3.420 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 01.11.2020 | | 3.500 | 2.684 | 0,07 |
| **Allegion US Holding Co., Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2021 | | 3.000 | 3.052 | 0,08 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 1.000 | 997 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 30.03.2025 | | 1.500 | 1.485 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 30.09.2024 | | 5.000 | 5.137 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 12.469 | 14.137 | 0,37 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 6.031 | 6.890 | 0,18 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 1.689 | 1.993 | 0,05 |
| **Alphabet Holding Co., Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.11.2017 (a) | | 9.000 | 8.797 | 0,23 |
| **Altice US Finance I Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.07.2023 | | 2.000 | 2.010 | 0,05 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2022 | | 4.000 | 4.015 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.07.2021 | | 1.500 | 1.582 | 0,04 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2021 | | 6.500 | 6.614 | 0,17 |
| 5,750 % fällig am 15.12.2023 | | 5.000 | 5.050 | 0,13 |
| **Amsted Industries, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2022 | | 7.000 | 7.035 | 0,18 |
| 5,375 % fällig am 15.09.2024 | | 2.500 | 2.462 | 0,06 |
| **Anixter, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 | | 6.750 | 6.801 | 0,18 |
| **Antero Resources Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2022 | | 4.000 | 3.060 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 01.11.2021 | | 3.000 | 2.415 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2020 | | 4.000 | 3.360 | 0,09 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.01.2024 | | 5.500 | 5.617 | 0,15 |
| **Argos Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.03.2023 | | 14.000 | 13.916 | 0,36 |
| **Ashland, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.08.2022 | $ | 9.000 | $ 8.786 | 0,23 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2043 | | 5.000 | 4.775 | 0,12 |
| **Associated Materials LLC** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.11.2017 | | 6.350 | 4.413 | 0,11 |
| **Axalta Coating Systems US Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | € | 5.050 | 5.708 | 0,15 |
| **Axiall Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | $ | 3.500 | 3.163 | 0,08 |
| **B&G Foods, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2021 | | 8.000 | 7.950 | 0,21 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.12.2023 | € | 2.300 | 2.578 | 0,07 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.10.2023 | $ | 5.000 | 5.119 | 0,13 |
| **Belden, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 4.000 | 3.870 | 0,10 |
| **BMC Software Finance, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.07.2021 | | 7.000 | 4.681 | 0,12 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.11.2020 | | 3.250 | 3.364 | 0,09 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.10.2019 (a) | | 3.000 | 1.871 | 0,05 |
| **Briggs & Stratton Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.12.2020 | | 2.000 | 2.180 | 0,06 |
| **Bristow Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 2.000 | 1.572 | 0,04 |
| **Building Materials Corporation of America** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 9.500 | 9.524 | 0,25 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2025 | | 3.000 | 3.075 | 0,08 |
| **Bumble Bee Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2017 | | 1.259 | 1.278 | 0,03 |
| **Cable One, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2022 | | 2.000 | 1.995 | 0,05 |
| **Cablevision Systems Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 6.000 | 5.115 | 0,13 |
| 8,000 % fällig am 15.04.2020 | | 2.500 | 2.444 | 0,06 |
| **CalAtlantic Group, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2022 | | 2.000 | 2.020 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 01.05.2020 | | 2.500 | 2.738 | 0,07 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 1.723 | 551 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 2.297 | 706 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 10.783 | 5.702 | 0,15 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2023 | | 8.500 | 7.671 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 7.500 | 6.647 | 0,17 |
| **Carrizo Oil & Gas, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.04.2023 | | 3.000 | 2.445 | 0,06 |
| **Case New Holland Industrial, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.12.2017 | | 5.250 | 5.578 | 0,14 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2023 | | 9.000 | 9.034 | 0,23 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | | 6.000 | 6.015 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2021 | | 1.000 | 1.041 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 30.09.2022 | | 10.000 | 10.125 | 0,26 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | | 1.750 | 1.746 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2023 | | 4.000 | 4.110 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 3.000 | 3.090 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2027 | | 2.500 | 2.494 | 0,06 |
| **CCOH Safari LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.02.2026 | | 10.000 | 10.050 | 0,26 |
| **Celanese US Holdings LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.11.2022 | | 2.000 | 1.980 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.06.2021 | | 2.000 | 2.120 | 0,05 |
| **Central Garden & Pet Co.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 2.000 | 2.030 | 0,05 |
| **Cequel Communications Holdings I LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2021 | | 3.000 | 2.711 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 15.09.2020 | | 7.000 | 6.869 | 0,18 |
| **Chemours Co.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2023 | € | 1.000 | 773 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 15.05.2023 | $ | 5.000 | 3.525 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2025 | | 3.000 | 2.055 | 0,05 |
| **Chemtura Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2021 | | 5.000 | 5.050 | 0,13 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | $ | 8.897 | $ 4.404 | 0,11 |
| **Churchill Downs, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.12.2021 | | 6.000 | 6.045 | 0,16 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 15.000 | 15.441 | 0,40 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 7.500 | 7.631 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2019 | | 3.000 | 3.142 | 0,08 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 13.000 | 12.654 | 0,33 |
| 7,625 % fällig am 15.03.2020 | | 7.500 | 6.956 | 0,18 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2019 | | 4.000 | 3.790 | 0,10 |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | | 3.000 | 2.835 | 0,07 |
| **Coeur Mining, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2021 | | 1.250 | 753 | 0,02 |
| **CommScope Technologies Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | | 3.750 | 3.619 | 0,09 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2021 | | 4.000 | 3.850 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.06.2024 | | 3.625 | 3.457 | 0,09 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 5.000 | 5.000 | 0,13 |
| 6,875 % fällig am 01.02.2022 | | 16.750 | 15.975 | 0,41 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2020 | | 1.000 | 1.001 | 0,03 |
| **Concho Resources, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2022 | | 2.000 | 1.830 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2023 | | 3.000 | 2.790 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | | 8.500 | 8.202 | 0,21 |
| **Consol Energy, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2022 | | 5.000 | 3.125 | 0,08 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 4.010 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 15.11.2024 | | 1.000 | 1.022 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 01.12.2025 | | 5.000 | 5.106 | 0,13 |
| **Continental Airlines 2005-ERJ1 Pass-Through Trust** | | | | |
| 9,798 % fällig am 01.04.2021 | | 35 | 39 | 0,00 |
| **Corrections Corporation of America** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.05.2023 | | 5.000 | 4.850 | 0,13 |
| **Countrywide Capital III** | | | | |
| 8,050 % fällig am 15.06.2027 | | 3.150 | 3.892 | 0,10 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2024 | | 4.000 | 3.640 | 0,09 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2022 | | 2.750 | 2.750 | 0,07 |
| **Crimson Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 33.000 | 22.687 | 0,59 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2023 | | 3.000 | 2.947 | 0,08 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2023 | | 6.500 | 6.857 | 0,18 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2024 | | 2.000 | 1.760 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2021 | | 3.000 | 2.955 | 0,08 |
| 8,625 % fällig am 15.02.2019 | | 4.000 | 4.270 | 0,11 |
| **Darling Ingredients, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2022 | | 4.000 | 3.955 | 0,10 |
| **DaVita HealthCare Partners, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2025 | | 9.500 | 9.191 | 0,24 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2024 | | 13.500 | 13.525 | 0,35 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2022 | | 5.000 | 5.169 | 0,13 |
| **Dean Foods Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2023 | | 6.000 | 6.255 | 0,16 |
| **Denali Borrower LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2020 | | 7.000 | 7.350 | 0,19 |
| **Denbury Resources, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2023 | | 5.000 | 1.634 | 0,04 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 4.500 | 3.915 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 5.000 | 4.675 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 7.000 | 6.247 | 0,16 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 5.000 | 5.050 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 3.000 | 3.270 | 0,08 |
| **DJO Finance LLC** | | | | |
| 10,750 % fällig am 15.04.2020 | | 2.150 | 1.956 | 0,05 |
| **DJO Finco, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.06.2021 | | 6.000 | 5.340 | 0,14 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Dollar Tree, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2020 | $ | 1.750 | $ 1.816 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2023 | | 7.000 | 7.280 | 0,19 |
| **Dynegy, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.11.2019 | | 10.000 | 9.450 | 0,25 |
| 7,375 % fällig am 01.11.2022 | | 4.000 | 3.500 | 0,09 |
| 7,625 % fällig am 01.11.2024 | | 5.000 | 4.299 | 0,11 |
| **Eagle Spinco, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | | 11.000 | 10.161 | 0,26 |
| **Endo Finance LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2022 | | 15.000 | 14.625 | 0,38 |
| 5,875 % fällig am 15.01.2023 | | 8.000 | 7.880 | 0,20 |
| **Energizer Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2025 | | 2.750 | 2.592 | 0,07 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2022 | | 6.500 | 6.402 | 0,17 |
| **EP Energy LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 01.05.2020 | | 5.000 | 3.212 | 0,08 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2026 | | 2.000 | 2.065 | 0,05 |
| **Era Group, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2022 | | 4.000 | 3.280 | 0,09 |
| **ESH Hospitality, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.05.2025 | | 5.500 | 5.390 | 0,14 |
| **First Data Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2024 | | 7.000 | 6.982 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 9.000 | 8.887 | 0,23 |
| 6,750 % fällig am 01.11.2020 | | 5.464 | 5.744 | 0,15 |
| 7,000 % fällig am 01.12.2023 | | 7.500 | 7.519 | 0,20 |
| **First Quality Finance Co., Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2021 | | 6.000 | 5.490 | 0,14 |
| **Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2020 | | 2.250 | 2.284 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.10.2024 | | 4.000 | 3.920 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 1.000 | 1.081 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 31.01.2022 | | 3.000 | 3.225 | 0,08 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2025 | | 7.000 | 5.792 | 0,15 |
| 8,875 % fällig am 15.09.2020 | | 2.500 | 2.537 | 0,07 |
| 10,500 % fällig am 15.09.2022 | | 1.000 | 999 | 0,03 |
| 11,000 % fällig am 15.09.2025 | | 3.000 | 2.977 | 0,08 |
| **Gardner Denver, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2021 | | 32.000 | 24.640 | 0,64 |
| **Gates Global LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2022 | € | 7.250 | 5.686 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | $ | 7.000 | 5.075 | 0,13 |
| **General Cable Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2022 | | 6.000 | 4.650 | 0,12 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.08.2022 | | 6.250 | 5.344 | 0,14 |
| **Geo Group, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.04.2023 | | 3.000 | 2.857 | 0,07 |
| **Getty Images, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.10.2020 | | 8.000 | 2.920 | 0,08 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.11.2023 | | 4.000 | 3.920 | 0,10 |
| **Graphic Packaging International, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.11.2022 | | 2.000 | 2.030 | 0,05 |
| **Griffon Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2022 | | 6.000 | 5.745 | 0,15 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | | 7.000 | 5.880 | 0,15 |
| **Halcon Resources Corp.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 01.02.2020 | | 2.000 | 1.387 | 0,04 |
| **HCA Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2021 | | 5.000 | 5.312 | 0,14 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 7.000 | 6.947 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 11.850 | 11.850 | 0,31 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2025 | | 5.000 | 5.050 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 3.250 | 3.213 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 11.750 | 12.426 | 0,32 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2023 | | 10.000 | 10.300 | 0,27 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2026 | | 5.000 | 5.031 | 0,13 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 1.000 | 1.092 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 9.000 | 10.012 | 0,26 |
| **HD Supply, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.12.2021 | $ | 6.000 | $ 6.142 | 0,16 |
| 7,500 % fällig am 15.07.2020 | | 17.000 | 17.765 | 0,46 |
| 11,500 % fällig am 15.07.2020 | | 5.000 | 5.562 | 0,14 |
| **Hearthside Group Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2022 | | 5.000 | 4.650 | 0,12 |
| **Hertz Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2020 | | 4.000 | 4.145 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 2.000 | 2.080 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 15.04.2019 | | 2.500 | 2.560 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 15.01.2021 | | 5.000 | 5.212 | 0,14 |
| **Hexion, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.04.2020 | | 10.000 | 7.825 | 0,20 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2021 | | 10.000 | 10.412 | 0,27 |
| **Hologic, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2022 | | 2.000 | 2.048 | 0,05 |
| **Horizon Pharma Financing, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | | 3.000 | 2.685 | 0,07 |
| **HUB International Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.10.2021 | | 7.000 | 6.318 | 0,16 |
| **Hughes Satellite Systems Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2019 | | 1.800 | 1.946 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 15.06.2021 | | 3.000 | 3.191 | 0,08 |
| **Huntington Ingalls Industries, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 2.500 | 2.556 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 15.11.2025 | | 4.750 | 4.833 | 0,13 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.04.2025 | € | 2.750 | 2.438 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 15.11.2020 | $ | 6.750 | 6.193 | 0,16 |
| 5,125 % fällig am 15.04.2021 | € | 2.250 | 2.282 | 0,06 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | $ | 9.000 | 6.311 | 0,16 |
| **IHS, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.11.2022 | | 1.700 | 1.728 | 0,04 |
| **IMS Health, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.11.2020 | | 5.000 | 5.163 | 0,13 |
| **Informatica LLC** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.07.2023 | | 5.000 | 4.550 | 0,12 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 3.000 | 3.203 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2019 | | 4.000 | 4.295 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 2.000 | 2.370 | 0,06 |
| **Jarden Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.11.2023 | | 2.375 | 2.440 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 01.05.2017 | | 1.750 | 1.798 | 0,05 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2022 | | 3.000 | 2.535 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 5.000 | 4.463 | 0,12 |
| **JMC Steel Group, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.03.2018 | | 5.000 | 3.353 | 0,09 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 01.11.2018 | | 14.000 | 13.685 | 0,36 |
| **Kloeckner Pentaplast of America, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.11.2020 | € | 4.125 | 4.595 | 0,12 |
| **KLX, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2022 | $ | 12.750 | 12.176 | 0,32 |
| **L Brands, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.02.2022 | | 2.000 | 2.128 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2021 | | 3.500 | 3.894 | 0,10 |
| **Lamar Media Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 4.070 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2022 | | 2.000 | 2.110 | 0,05 |
| **Land O'Lakes, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 4.000 | 4.200 | 0,11 |
| **Laredo Petroleum, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.01.2022 | | 1.000 | 875 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2023 | | 2.000 | 1.750 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2022 | | 5.000 | 4.625 | 0,12 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.12.2016 (b) | | 14.200 | 1.072 | 0,03 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 3.985 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2024 | | 2.000 | 2.015 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | | 3.500 | 3.496 | 0,09 |
| **LifePoint Health, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2023 | | 2.500 | 2.544 | 0,07 |
| **LIN Television Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2022 | $ | 3.000 | $ 2.993 | 0,08 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.09.2020 | | 4.000 | 4.160 | 0,11 |
| **Manitowoc Co., Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2022 | | 2.250 | 2.334 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 01.11.2020 | | 4.000 | 4.150 | 0,11 |
| **Matador Resources Co.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2023 | | 1.500 | 1.403 | 0,04 |
| **MEDNAX, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2023 | | 5.000 | 5.038 | 0,13 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 5.000 | 4.975 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 15.03.2023 | | 11.000 | 10.945 | 0,28 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | | 17.000 | 17.489 | 0,45 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 6.500 | 6.711 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | | 7.500 | 7.997 | 0,21 |
| 8,625 % fällig am 01.02.2019 | | 3.000 | 3.338 | 0,09 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.04.2022 | | 8.500 | 8.543 | 0,22 |
| **MPLX LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 | | 7.500 | 6.748 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 01.12.2024 | | 2.500 | 2.256 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2025 | | 2.500 | 2.250 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2023 | | 2.000 | 1.760 | 0,05 |
| **MSCI, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | | 5.000 | 5.138 | 0,13 |
| **Murphy Oil USA, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2023 | | 4.000 | 4.220 | 0,11 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.06.2019 | | 5.000 | 4.613 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 4.000 | 3.520 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 25.10.2024 | | 5.000 | 4.019 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 25.03.2024 | | 7.000 | 5.731 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 5.000 | 4.953 | 0,13 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 5.000 | 5.275 | 0,14 |
| **NBTY, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.10.2018 | | 4.000 | 4.060 | 0,11 |
| **NCR Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | | 3.000 | 2.869 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.12.2021 | | 4.000 | 3.955 | 0,10 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2023 | | 2.400 | 2.373 | 0,06 |
| **Neptune Finco Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.10.2025 | | 5.000 | 5.213 | 0,14 |
| 10,125 % fällig am 15.01.2023 | | 2.250 | 2.351 | 0,06 |
| **NeuStar, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2023 | | 2.000 | 1.612 | 0,04 |
| **Newfield Exploration Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.01.2026 | | 2.000 | 1.665 | 0,04 |
| 5,625 % fällig am 01.07.2024 | | 5.000 | 4.288 | 0,11 |
| **Nexeo Solutions LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.03.2018 | | 3.250 | 3.063 | 0,08 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2020 | | 4.000 | 4.075 | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2022 | | 5.000 | 4.956 | 0,13 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.07.2022 | | 5.500 | 4.714 | 0,12 |
| 6,625 % fällig am 15.03.2023 | | 5.750 | 5.017 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 15.01.2018 | | 5.000 | 5.238 | 0,14 |
| 7,875 % fällig am 15.05.2021 | | 6.000 | 5.655 | 0,15 |
| 8,250 % fällig am 01.09.2020 | | 5.000 | 4.875 | 0,13 |
| **NSG Holdings LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | | 3.068 | 3.329 | 0,09 |
| **Oasis Petroleum, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2021 | | 2.000 | 1.335 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 3.225 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 15.01.2023 | | 2.000 | 1.250 | 0,03 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.12.2021 | | 7.000 | 7.035 | 0,18 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2022 | | 1.500 | 1.539 | 0,04 |
| 5,625 % fällig am 15.02.2024 | | 2.500 | 2.578 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2025 | | 1.000 | 1.019 | 0,03 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 2.000 | 1.920 | 0,05 |
| **Party City Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2023 | | 3.000 | 2.925 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Penn National Gaming, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | $ | 5.000 | $ 4.875 | 0,13 |
| **Petco Animal Supplies, Inc.** | | | | |
| 9,250 % fällig am 01.12.2018 | | 4.000 | 4.110 | 0,11 |
| **Petco Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.10.2017 (a) | | 6.000 | 6.113 | 0,16 |
| **PHH Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | | 4.250 | 3.889 | 0,10 |
| **Pilgrim's Pride Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2025 | | 5.000 | 4.875 | 0,13 |
| **Pinnacle Entertainment, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | | 5.000 | 5.237 | 0,14 |
| **Pinnacle Foods Finance LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2021 | | 10.000 | 9.625 | 0,25 |
| **Pinnacle Operating Corp.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.11.2020 | | 1.750 | 1.649 | 0,04 |
| **Platform Specialty Products Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2022 | | 9.000 | 7.830 | 0,20 |
| **Ply Gem Industries, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2022 | | 7.750 | 7.120 | 0,18 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.12.2022 | | 8.000 | 7.870 | 0,20 |
| 6,750 % fällig am 01.12.2021 | | 10.500 | 10.736 | 0,28 |
| 7,375 % fällig am 15.02.2022 | | 5.250 | 5.493 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2024 | | 3.500 | 3.675 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | 3.188 | 0,08 |
| **Prestige Brands, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.12.2021 | | 7.000 | 6.755 | 0,18 |
| 8,125 % fällig am 01.02.2020 | | 3.000 | 3.120 | 0,08 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.06.2021 | | 2.000 | 1.945 | 0,05 |
| **PSPC Escrow Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.02.2023 | € | 8.000 | 7.495 | 0,19 |
| **PVH Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.12.2022 | $ | 6.500 | 6.386 | 0,17 |
| **Qorvo, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.12.2023 | | 2.000 | 2.045 | 0,05 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 5.000 | 4.781 | 0,12 |
| **Quintiles Transnational Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | 5.050 | 0,13 |
| **Range Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 5.000 | 3.763 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 3.750 | 0,10 |
| **Red Oak Power LLC** | | | | |
| 8,540 % fällig am 30.11.2019 | | 925 | 967 | 0,03 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | | 7.000 | 6.312 | 0,16 |
| **Reynolds Group Issuer, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2020 | | 7.500 | 7.648 | 0,20 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 3.000 | 3.098 | 0,08 |
| 8,250 % fällig am 15.02.2021 | | 9.000 | 8.708 | 0,23 |
| **RHP Hotel Properties LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2023 | | 5.000 | 5.025 | 0,13 |
| **Rice Energy, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2022 | | 2.500 | 1.813 | 0,05 |
| **Rite Aid Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2023 | | 8.000 | 8.310 | 0,22 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | | 6.250 | 5.781 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | | 4.250 | 4.059 | 0,11 |
| 6,850 % fällig am 15.07.2018 | | 1.900 | 1.872 | 0,05 |
| **Rose Rock Midstream LP** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.11.2023 | | 1.000 | 715 | 0,02 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 2.000 | 1.850 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 6.000 | 5.295 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 13.500 | 11.813 | 0,31 |
| **Sabre GLBL, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2023 | | 4.500 | 4.472 | 0,12 |
| **Sally Holdings LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.12.2025 | | 7.600 | 7.714 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2022 | | 4.000 | 4.160 | 0,11 |
| **Sanchez Energy Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2023 | | 7.000 | 3.815 | 0,10 |
| **SandRidge Energy, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.03.2021 | $ | 1.000 | $ 110 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2023 | | 1.000 | 114 | 0,00 |
| **SBA Communications Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2022 | | 4.000 | 3.955 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2019 | | 1.000 | 1.046 | 0,03 |
| **SBA Telecommunications, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2020 | | 2.500 | 2.609 | 0,07 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.09.2020 | | 4.500 | 2.138 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 01.01.2022 | | 2.750 | 2.640 | 0,07 |
| 10,000 % fällig am 01.12.2022 | | 4.000 | 2.860 | 0,07 |
| **Scotts Miracle-Gro Co.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2023 | | 4.200 | 4.400 | 0,11 |
| **Sealed Air Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2022 | | 1.000 | 1.006 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 01.12.2024 | | 3.750 | 3.769 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 01.04.2023 | | 6.000 | 6.150 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 01.12.2020 | | 5.150 | 5.704 | 0,15 |
| **Selectica, Inc.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 31.12.2049 | | 1.405 | 0 | 0,00 |
| **Sequa Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.12.2017 | | 7.000 | 2.258 | 0,06 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.10.2020 | | 4.000 | 4.200 | 0,11 |
| **Signode Industrial Group Lux S.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2022 | | 10.000 | 8.550 | 0,22 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2025 | | 8.000 | 8.070 | 0,21 |
| **Smithfield Foods, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.08.2021 | | 1.000 | 1.033 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2022 | | 8.000 | 8.330 | 0,22 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | | 7.000 | 7.210 | 0,19 |
| 6,375 % fällig am 15.11.2020 | | 1.000 | 1.068 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2022 | | 10.000 | 10.600 | 0,28 |
| **Springs Industries, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.06.2021 | | 8.000 | 7.960 | 0,21 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | | 8.500 | 5.950 | 0,15 |
| 6,900 % fällig am 01.05.2019 | | 4.000 | 3.280 | 0,09 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 14.500 | 10.911 | 0,28 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 19.250 | 13.619 | 0,35 |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | | 4.250 | 4.271 | 0,11 |
| 9,000 % fällig am 15.11.2018 | | 3.000 | 3.165 | 0,08 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 15.000 | 10.894 | 0,28 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 1.000 | 757 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 10.000 | 7.535 | 0,20 |
| **SPX FLOW, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.09.2017 | | 1.500 | 1.601 | 0,04 |
| **Starz LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2019 | | 2.720 | 2.761 | 0,07 |
| **Steel Dynamics, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 5.500 | 5.046 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 15.08.2019 | | 2.500 | 2.531 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 15.08.2022 | | 2.250 | 2.171 | 0,06 |
| **Sterigenics-Nordion Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2023 | | 3.000 | 2.873 | 0,07 |
| **Suburban Propane Partners LP** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.08.2021 | | 568 | 548 | 0,01 |
| **Sun Products Corp.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2021 | | 8.000 | 6.980 | 0,18 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2019 | | 5.000 | 3.775 | 0,10 |
| **Targa Resources Partners LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.11.2019 | | 1.250 | 1.047 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 15.11.2023 | | 3.450 | 2.674 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2018 | | 2.000 | 1.860 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 01.05.2023 | | 7.500 | 6.113 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 01.08.2022 | | 1.874 | 1.626 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 01.10.2020 | | 3.000 | 2.723 | 0,07 |
| **TEGNA, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2021 | | 1.750 | 1.759 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | | 2.500 | 2.506 | 0,07 |
| **Tempur Sealy International, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2023 | $ | 3.750 | $ 3.806 | 0,10 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2021 | | 3.000 | 2.910 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2021 | | 9.750 | 9.555 | 0,25 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2019 | | 5.000 | 4.638 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2020 | | 3.500 | 3.701 | 0,10 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 2.000 | 1.859 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 01.08.2020 | | 3.000 | 3.023 | 0,08 |
| 8,125 % fällig am 01.04.2022 | | 5.000 | 5.013 | 0,13 |
| **Terex Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2021 | | 4.000 | 3.700 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 01.04.2020 | | 500 | 484 | 0,01 |
| **Terraform Global Operating LLC** | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | | 2.000 | 1.605 | 0,04 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2023 | | 6.000 | 4.995 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2025 | | 2.000 | 1.620 | 0,04 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 5.000 | 4.763 | 0,12 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2023 | | 4.000 | 4.060 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 01.04.2021 | | 6.750 | 6.969 | 0,18 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2025 | | 3.000 | 3.045 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2026 | | 6.125 | 6.198 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2023 | | 10.000 | 10.225 | 0,27 |
| 6,731 % fällig am 28.04.2022 | | 6.000 | 6.270 | 0,16 |
| 6,836 % fällig am 28.04.2023 | | 5.000 | 5.188 | 0,13 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2020 | | 6.000 | 5.835 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | | 10.000 | 9.825 | 0,25 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2024 | | 12.000 | 11.994 | 0,31 |
| 7,500 % fällig am 15.07.2021 | | 2.000 | 2.080 | 0,05 |
| **TreeHouse Foods, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2022 | | 8.000 | 7.640 | 0,20 |
| **Tribune Media Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 4.000 | 4.010 | 0,10 |
| **Tronox Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2020 | | 4.000 | 2.427 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 2.912 | 0,08 |
| **United Rentals North America, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.06.2023 | | 1.750 | 1.798 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | | 2.000 | 2.115 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 15.04.2022 | | 5.000 | 5.369 | 0,14 |
| 8,250 % fällig am 01.02.2021 | | 918 | 965 | 0,02 |
| **Univar USA, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2023 | | 4.500 | 4.118 | 0,11 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 10.000 | 9.675 | 0,25 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 17.500 | 16.669 | 0,43 |
| 6,750 % fällig am 15.09.2022 | | 5.757 | 5.987 | 0,16 |
| **USG Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 4.000 | 4.075 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | | 2.000 | 2.090 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 30.03.2020 | | 2.000 | 2.105 | 0,05 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.08.2021 | | 10.000 | 9.700 | 0,25 |
| 7,000 % fällig am 01.10.2020 | | 5.000 | 5.013 | 0,13 |
| 7,250 % fällig am 15.07.2022 | | 8.000 | 7.860 | 0,20 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.05.2023 | | 5.000 | 4.866 | 0,13 |
| **VWR Funding, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2022 | € | 17.900 | 19.099 | 0,50 |
| **WhiteWave Foods Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2022 | $ | 3.000 | 3.180 | 0,08 |
| **Whiting Petroleum Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2019 | | 2.250 | 1.710 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.03.2021 | | 8.000 | 5.872 | 0,15 |
| **Williams Partners LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | 4.059 | 0,11 |
| **Wise Metals Group LLC** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.12.2018 | | 3.000 | 2.288 | 0,06 |
| **Wolverine World Wide, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.10.2020 | | 2.250 | 2.351 | 0,06 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.08.2020 | | 2.000 | 1.630 | 0,04 |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | | 3.000 | 2.408 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | $ | 6.000 | $ 5.156 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 4.757 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 8.500 | 7.608 | 0,20 |
| **XPO Logistics, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2021 | € | 6.250 | 6.344 | 0,16 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | $ | 7.000 | 7.144 | 0,19 |
| **Zebra Technologies Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.10.2022 | | 7.000 | 7.333 | 0,19 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € | 10.000 | 10.421 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | $ | 1.000 | 1.012 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 3.500 | 3.434 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | | 2.000 | 1.913 | 0,05 |
| | | | 2.082.575 | 54,06 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 2,743 % fällig am 25.03.2036 (b) | | 119 | 91 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,623 % fällig am 25.03.2034 | $ | 7 | $ 7 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,712 % fällig am 19.10.2036 (b) | | 544 | 252 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 19.03.2037 | | 225 | 192 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,264 % fällig am 25.02.2036 (b) | | 442 | 402 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,408 % fällig am 25.09.2036 (b) | | 26 | 24 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 1,027 % fällig am 25.04.2047 (b) | | 186 | 22 | 0,00 |
| 1,097 % fällig am 25.05.2047 (b) | | 212 | 18 | 0,00 |
| 1,227 % fällig am 25.05.2046 | | 215 | 154 | 0,00 |
| | | | 1.162 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Cook County, Illinois, Finance Authority Sports Facility Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2014 (b) | $ 250 | $ 63 | 0,00 |
| Summe USA | | 2.084.498 | 54,11 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 33.842.608 | 338.494 | 8,79 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.783.250** | **98,21** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | $ 77.600 | $ (236) | (0,01) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 50.000 | (462) | (0,01) |
| | | | | $ (698) | (0,02) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ (698)** | **(0,02)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 469.446 | $ | 500.517 | BOA | $ 0 | $ (9.443) | $ (9.443) | (0,24) |
| 01/2016 | | 14 | | 15 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.602 | | 5.999 | BPS | 0 | (86) | (86) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.071 | | 3.258 | CBK | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 61 | € | 56 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.930 | | 4.625 | GLM | 94 | 0 | 94 | 0,00 |
| 01/2016 | | 521.221 | | 474.516 | HUS | 165 | (5.919) | (5.754) | (0,15) |
| 01/2016 | € | 4.955 | $ | 5.416 | JPM | 38 | (5) | 33 | 0,00 |
| 01/2016 | | 346 | | 380 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 267 | € | 244 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 29 | | 27 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 8.188 | $ | 8.987 | UAG | 92 | 0 | 92 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 13.199 | € | 12.467 | UAG | 343 | 0 | 343 | 0,01 |
| 01/2016 | | 1.587 | £ | 1.047 | BOA | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 432 | $ | 646 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | | 163 | | 241 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 167 | | 252 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 26 | | 39 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.735 | | 5.709 | BPS | 204 | 0 | 204 | 0,01 |
| 01/2016 | | 338 | | 501 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 136.314 | | 205.940 | CBK | 5.027 | 0 | 5.027 | 0,13 |
| 01/2016 | | 3.752 | | 5.697 | JPM | 166 | 0 | 166 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 211.453 | £ | 142.827 | MSB | 0 | (940) | (940) | (0,02) |
| 01/2016 | | 99 | | 67 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 151 | $ | 224 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 14.108 | | 14.131 | DUB | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 158 | CHF | 160 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 2.436 | $ | 2.677 | CBK | 28 | 0 | 28 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € 468.098 | $ 514.779 | HUS | $ 5.923 | $ 0 | $ 5.923 | 0,15 |
| 02/2016 | 4.545 | 4.975 | JPM | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 02/2016 | 595 | 649 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.154 | £ 773 | CBK | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | £ 142.827 | $ 211.467 | MSB | 937 | 0 | 937 | 0,02 |
| | | | | $ 13.092 | $ (16.530) | $ (3.438) | (0,09) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (3.438)** | **(0,09)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.779.114** | **98,10** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 31 | $ 45 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 29 | 29 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 793 | 793 | 0,02 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 180 | 21 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 81 | 9 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 9 | 9 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 247 | 247 | 0,01 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 14 | 14 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 238 | 238 | 0,01 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 837 | 95 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1.898 | 2.061 | 0,05 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 10 | 14 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 3.586** | **0,09** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 69.722** | **1,81** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 3.852.422** | **100,00** |

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

(a) Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier ist in Verzug.

(c) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 22.280 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.

(e) Barmittel in Höhe von USD 11.850 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(f) Beschränkt übertragbare Wertpapiere

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 15,000 % | 25.04.2016 | 30.04.2015 | $ 5.502 | $ 2.337 | 0,06 |
| Groupe Novasep SAS | | | 15.03.2012 | 1.619 | 698 | 0,02 |
| | | | | $ 7.121 | $ 3.035 | 0,08 |

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 339.192 | $ 3.441.721 | $ 2.337 | $ 3.783.250 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (4.136) | 0 | (4.136) |
| **Summen** | **$ 339.192** | **$ 3.437.585** | **$ 2.337** | **$ 3.779.114** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 317.506 | $ 3.598.139 | $ 4.391 | $ 3.920.036 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 18.122 | 0 | 18.122 |
| **Summen** | **$ 317.506** | **$ 3.616.261** | **$ 4.391** | **$ 3.938.158** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(h) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 13.632 | CHF 13.994 | BOA | $ 348 | $ 0 | $ 348 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 294 | $ 289 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | 742 | 741 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.191 | 14.356 | CBK | 179 | 0 | 179 | 0,00 |
| 01/2016 | 20 | 19 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 13.915 | CHF 14.207 | DUB | 278 | 0 | 278 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 997 | $ 974 | FBF | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 13.925 | CHF 14.222 | JPM | 284 | 0 | 284 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 13.977 | $ 14.151 | JPM | 188 | 0 | 188 | 0,00 |
| 01/2016 | 13.486 | 13.618 | MSB | 146 | 0 | 146 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 14 | CHF 14 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.008 | 14.225 | UAG | 203 | 0 | 203 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 13.977 | $ 14.150 | UAG | 187 | 0 | 187 | 0,00 |
| 02/2016 | 69 | 70 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 14.086 | CHF 13.906 | CBK | 0 | (176) | (176) | 0,00 |
| 02/2016 | 14.169 | 13.977 | JPM | 0 | (188) | (188) | (0,01) |
| 02/2016 | 12.797 | 12.661 | MSB | 0 | (133) | (133) | 0,00 |
| 02/2016 | 14.166 | 13.977 | UAG | 0 | (186) | (186) | 0,00 |
| | | | | $ 1.814 | $ (709) | $ 1.105 | 0,03 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 206.081 | $ 226.442 | BOA | $ 2.576 | $ 0 | $ 2.576 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 231.625 | € 217.253 | BOA | 4.377 | 0 | 4.377 | 0,11 |
| 01/2016 | € 20.386 | $ 22.347 | BPS | 201 | 0 | 201 | 0,01 |
| 01/2016 | 10.233 | 11.116 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 29.813 | 32.199 | CBK | 120 | (307) | (187) | (0,01) |
| 01/2016 | $ 3.284 | € 3.036 | CBK | 25 | (11) | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | € 1.675 | $ 1.792 | DUB | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 165.921 | € 156.593 | GLM | 4.185 | 0 | 4.185 | 0,11 |
| 01/2016 | € 206.076 | $ 226.466 | HUS | 2.606 | 0 | 2.606 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 230.681 | € 216.465 | HUS | 4.465 | 0 | 4.465 | 0,12 |
| 01/2016 | € 142.349 | $ 155.554 | JPM | 920 | 0 | 920 | 0,02 |
| 01/2016 | 281 | 299 | NAB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | 550 | 600 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 14.184 | € 12.947 | SCX | 0 | (119) | (119) | 0,00 |
| 01/2016 | 8 | 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 230.065 | 216.489 | UAG | 5.106 | 0 | 5.106 | 0,13 |
| 01/2016 | € 216.761 | $ 236.729 | UAG | 1.302 | (41) | 1.261 | 0,03 |
| 02/2016 | $ 226.860 | € 206.315 | BOA | 0 | (2.581) | (2.581) | (0,07) |
| 02/2016 | 226.627 | 206.076 | HUS | 0 | (2.608) | (2.608) | (0,07) |
| 02/2016 | 155.661 | 142.349 | JPM | 0 | (917) | (917) | (0,02) |
| 02/2016 | € 7 | $ 8 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 225.694 | € 206.477 | UAG | 0 | (1.239) | (1.239) | (0,03) |
| | | | | $ 25.885 | $ (7.858) | $ 18.027 | 0,47 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 972 | £ 647 | AZD | $ 0 | $ (18) | $ (18) | 0,00 |
| 01/2016 | 4.320 | 2.870 | BOA | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 1.519 | $ 2.289 | BOA | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 283.420 | £ 188.330 | BPS | 0 | (5.841) | (5.841) | (0,15) |
| 01/2016 | £ 264 | $ 398 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | 227.721 | 338.242 | CBK | 2.605 | 0 | 2.605 | 0,06 |
| 01/2016 | $ 317.314 | £ 210.035 | CBK | 0 | (7.744) | (7.744) | (0,20) |
| 01/2016 | 318.189 | 211.077 | DUB | 0 | (7.082) | (7.082) | (0,18) |
| 01/2016 | 249 | 164 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 207.729 | $ 308.265 | JPM | 2.093 | 0 | 2.093 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 315.367 | £ 209.179 | MSB | 0 | (7.059) | (7.059) | (0,18) |
| 01/2016 | £ 207.729 | $ 307.540 | MSB | 1.368 | 0 | 1.368 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 450 | £ 304 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 10.550 | $ 15.549 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 187.269 | 277.154 | SCX | 1.138 | 0 | 1.138 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 643 | £ 427 | UAG | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | 305.795 | 206.049 | CBK | 0 | (2.076) | (2.076) | (0,05) |
| 02/2016 | 308.277 | 207.729 | JPM | 0 | (2.081) | (2.081) | (0,05) |
| 02/2016 | 307.560 | 207.729 | MSB | 0 | (1.364) | (1.364) | (0,04) |
| 02/2016 | 277.175 | 187.269 | SCX | 0 | (1.137) | (1.137) | (0,03) |
| 02/2016 | 1.416 | 949 | UAG | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | | | | $ 7.262 | $ (34.533) | $ (27.271) | (0,71) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 84 | NOK 729 | BPS | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 35 | $ 4 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 43 | 5 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 41 | 5 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 76 | NOK 658 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 84 | 730 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 84 | 730 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 332 | $ 38 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (6) | $ (6) | 0,00 |

**(i) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 41.432 | $ 45.217 | $ (173) | $ 0 | $ (173) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (18) | $ 0 | $ (18) |
| BOA | (4.797) | 6.090 | 1.293 |
| BPS | (5.515) | 3.920 | (1.595) |
| BRC | (1) | 0 | (1) |
| CBK | (2.419) | 2.300 | (119) |
| DUB | (6.818) | (1.680) | (8.498) |
| FBF | (22) | 10 | (12) |
| GLM | 4.106 | (6.780) | (2.674) |
| HUS | 4.631 | (6.000) | (1.369) |
| JPM | 524 | (540) | (16) |
| MSB | (7.041) | 5.120 | (1.921) |
| NAB | (6) | 0 | (6) |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (116) | 0 | (116) |
| UAG | 5.737 | (7.520) | (1.783) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,21 | 100,58 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,02) | 0,02 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,09) | 0,45 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global High Yield Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 204.989.722 | $ 2.051.154 |
| VWR Funding, Inc. 4,625 % fällig am 15.04.2022 | € | 17.900 | 19.031 |
| Univision Communications, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2025 | $ | 17.500 | 17.398 |
| Altice Financing S.A. 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 16.500 | 16.844 |
| SIG Combibloc Holdings SCA 7,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 14.400 | 16.633 |
| Argos Merger Sub, Inc. 7,125 % fällig am 15.03.2023 | $ | 14.000 | 14.085 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 12.750 | 12.598 |
| ZF North America Capital, Inc. 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € | 10.000 | 10.631 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 10.000 | 10.102 |
| Verisure Holding AB 6,000 % fällig am 01.11.2022 | € | 9.000 | 10.050 |
| CCOH Safari LLC 5,750 % fällig am 15.02.2026 | $ | 10.000 | 10.004 |
| Endo Ltd. 6,000 % fällig am 15.07.2023 | | 10.000 | 9.953 |
| DaVita HealthCare Partners, Inc. 5,000 % fällig am 01.05.2025 | | 9.500 | 9.383 |
| New Look Secured Issuer PLC 6,500 % fällig am 01.07.2022 | £ | 6.000 | 9.284 |
| PSPC Escrow Corp. 6,500 % fällig am 01.02.2022 | $ | 9.000 | 9.187 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 15.05.2015 | | 9.100 | 9.098 |
| First Data Corp. 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 9.000 | 8.996 |
| PSPC Escrow Corp. 6,000 % fällig am 01.02.2023 | € | 8.000 | 8.895 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 4,500 % fällig am 15.05.2023 | | 8.250 | 8.745 |
| Barclays PLC 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 5.600 | 8.732 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 201.764.995 | $ 2.018.900 |
| Deutsche Bank AG 6,000 % fällig am 30.04.2022 | € | 11.400 | 12.518 |
| Lloyds Banking Group PLC 6,375 % fällig am 27.06.2049 | | 10.684 | 12.412 |
| Univision Communications, Inc. 8,500 % fällig am 15.05.2021 | $ | 10.000 | 10.612 |
| Aramark Services, Inc. 5,750 % fällig am 15.03.2020 | | 10.000 | 10.459 |
| CBRE Services, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 10.000 | 10.243 |
| H.J. Heinz Finance Co. 7,125 % fällig am 01.08.2039 | | 7.500 | 9.340 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 15.05.2015 | | 9.100 | 9.098 |
| Crown Castle International Corp. 5,250 % fällig am 15.01.2023 | | 8.500 | 8.899 |
| Finmeccanica SpA 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 5.000 | 8.897 |
| Bakkavor Finance 2 PLC 8,250 % fällig am 15.02.2018 | | 5.000 | 7.784 |
| Arrow Global Finance PLC 7,875 % fällig am 01.03.2020 | | 4.700 | 7.744 |
| R&R Ice Cream PLC 5,500 % fällig am 15.05.2020 | | 4.950 | 7.632 |
| Financiere Gaillon 8 SAS 7,000 % fällig am 30.09.2019 | € | 6.700 | 7.494 |
| Biomet, Inc. 6,500 % fällig am 01.10.2020 | $ | 7.000 | 7.364 |
| General Motors Financial Co., Inc. 4,250 % fällig am 15.05.2023 | | 7.000 | 7.097 |
| Novacap International SAS 4,995 % fällig am 01.05.2019 | € | 6.000 | 6.888 |
| UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 6.500 | 6.660 |
| LGE HoldCo VI BV 7,125 % fällig am 15.05.2024 | € | 5.000 | 6.496 |
| Kraft Heinz Foods Co. 4,875 % fällig am 15.02.2025 | $ | 5.984 | 6.433 |

(a) Der Global High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Caterpillar Financial Australia Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.05.2017 | AUD | 24.200 | $ 17.952 | 0,14 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.06.2019 | $ | 8.000 | 7.955 | 0,06 |
| 2,400 % fällig am 02.11.2020 | | 25.000 | 24.783 | 0,19 |
| **Driver Australia One Trust** | | | | |
| 2,915 % fällig am 21.12.2021 | AUD | 1.991 | 1.446 | 0,01 |
| **Goodman Funding Pty Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 22.03.2022 | $ | 500 | 556 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 12.11.2020 | | 13.650 | 15.518 | 0,12 |
| 6,375 % fällig am 15.04.2021 | | 7.800 | 8.876 | 0,07 |
| **LeasePlan Australia Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 13.03.2017 | AUD | 16.000 | 11.752 | 0,09 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 22.02.2017 | $ | 23.000 | 23.794 | 0,19 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 23.07.2020 | | 16.200 | 16.270 | 0,13 |
| **Progress Trust** | | | | |
| 3,615 % fällig am 18.06.2044 | AUD | 19.342 | 14.263 | 0,11 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 2.700 | 2.536 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 22.02.2021 | | 6.260 | 6.791 | 0,05 |
| **Virgin Australia 2013-1A Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.10.2023 | | 1.359 | 1.405 | 0,01 |
| **Westpac Securitisation Trust** | | | | |
| 3,365 % fällig am 20.01.2041 | AUD | 1.398 | 1.023 | 0,01 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2025 | $ | 300 | 266 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 850 | 863 | 0,01 |
| | | | 156.049 | 1,22 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 14.200 | 15.514 | 0,12 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| **Montpelier Re Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.10.2022 | | 4.500 | 4.581 | 0,04 |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.10.2016 | | 500 | 506 | 0,00 |
| **Weatherford International Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2022 | | 16.000 | 11.540 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 15.09.2020 | | 9.700 | 7.869 | 0,06 |
| | | | 24.496 | 0,19 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2018 | € | 1.000 | 1.019 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | $ | 12.543 | 9.595 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 20.01.2016 | € | 3.100 | 3.369 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 29.10.2049 | $ | 12.300 | 6.027 | 0,05 |
| 9,000 % fällig am 29.06.2049 | | 2.976 | 1.964 | 0,02 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.09.2017 | € | 6.100 | 6.228 | 0,05 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | $ | 4.000 | 3.995 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | | 35.650 | 36.131 | 0,28 |
| **Banco Votorantim S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 11.02.2016 | | 14.000 | 14.007 | 0,11 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 264.000 | 59.851 | 0,47 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 195.700 | 39.500 | 0,31 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 129.143 | 24.582 | 0,19 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 573.550 | 103.724 | 0,81 |
| **Globo Comunicacao e Participacoes S.A.** | | | | |
| 4,843 % fällig am 08.06.2025 | $ | 3.000 | 2.715 | 0,02 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 3.400 | 3.324 | 0,03 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 4.050 | 3.088 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 01.04.2019 | € | 600 | $ 480 | 0,00 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | $ | 300 | 214 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 3.000 | 2.813 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 19.300 | 12.786 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 3.500 | 2.616 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 2.800 | 2.205 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 1.100 | 792 | 0,01 |
| | | | 341.125 | 2,67 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 30.800 | 30.663 | 0,24 |
| **GTL Trade Finance, Inc.** | | | | |
| 5,893 % fällig am 29.04.2024 | | 21.005 | 15.019 | 0,12 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | | 4.300 | 4.171 | 0,03 |
| | | | 49.853 | 0,39 |
| **KANADA** | | | | |
| **Air Canada 2013-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2025 | | 987 | 987 | 0,01 |
| **Canada Housing Trust No.1** | | | | |
| 1,850 % fällig am 15.12.2016 (a) | CAD | 83.700 | 60.963 | 0,48 |
| **Canadian Oil Sands Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.04.2022 | $ | 9.000 | 8.084 | 0,06 |
| 7,750 % fällig am 15.05.2019 | | 20.700 | 22.192 | 0,17 |
| **Goldcorp, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 09.06.2021 | | 8.500 | 7.991 | 0,06 |
| **Precision Drilling Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2024 | | 9.200 | 6.302 | 0,05 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 1,600 % fällig am 21.09.2016 | | 33.100 | 33.233 | 0,26 |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 (a) | CAD | 172.000 | 126.579 | 0,99 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 (a) | | 26.750 | 20.831 | 0,16 |
| 3,500 % fällig am 02.06.2024 (a) | | 17.300 | 13.717 | 0,11 |
| **Province of Quebec (a)** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.09.2025 | | 1.600 | 1.190 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 26.750 | 21.251 | 0,17 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,100 % fällig am 14.10.2020 | $ | 2.075 | 2.042 | 0,02 |
| **Thomson Reuters Corp.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 23.11.2043 | | 575 | 603 | 0,01 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 0,856 % fällig am 23.07.2018 | | 17.200 | 17.139 | 0,13 |
| 2,500 % fällig am 14.12.2020 | | 2.300 | 2.302 | 0,02 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 15.400 | 14.553 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 2.000 | 1.790 | 0,01 |
| **West Fraser Timber Co. Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.10.2024 | | 6.000 | 5.602 | 0,04 |
| | | | 367.351 | 2,87 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Alpha Star Holding Ltd.** | | | | |
| 4,970 % fällig am 09.04.2019 | | 500 | 435 | 0,00 |
| **Anstock II Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.07.2017 | | 3.250 | 3.211 | 0,03 |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.05.2021 | | 48.310 | 48.280 | 0,38 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 09.06.2019 | | 1.200 | 1.195 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2020 | | 19.600 | 19.400 | 0,15 |
| **BlackRock Senior Income** | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.04.2019 | | 581 | 580 | 0,00 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 0,601 % fällig am 10.05.2021 | | 1.559 | 1.549 | 0,01 |
| 0,674 % fällig am 01.03.2021 | | 285 | 283 | 0,00 |
| **Eagle I Ltd.** | | | | |
| 2,570 % fällig am 15.12.2039 | | 4.988 | 4.947 | 0,04 |
| **ECAF I Ltd.** | | | | |
| 4,947 % fällig am 15.06.2040 | | 14.000 | 13.893 | 0,11 |
| **Elm CLO Ltd.** | | | | |
| 1,715 % fällig am 17.01.2023 | | 23.620 | 23.692 | 0,19 |
| **Fore CLO Ltd.** | | | | |
| 0,562 % fällig am 20.07.2019 | | 78 | 78 | 0,00 |
| **Inwood Park CDO Ltd.** | | | | |
| 0,542 % fällig am 20.01.2021 | $ | 1.582 | $ 1.581 | 0,01 |
| **LCM IX LP** | | | | |
| 1,521 % fällig am 14.07.2022 | | 8.876 | 8.869 | 0,07 |
| **MCE Finance Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | | 12.384 | 11.331 | 0,09 |
| **Mountain View Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 0,581 % fällig am 15.04.2019 | | 961 | 956 | 0,01 |
| **Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 8.949 | 3.311 | 0,03 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 184 | 42 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 7.141 | 1.714 | 0,01 |
| **Preferred Term Securities XIII Ltd.** | | | | |
| 1,076 % fällig am 24.03.2034 | | 631 | 530 | 0,00 |
| **Race Point V CLO Ltd.** | | | | |
| 1,812 % fällig am 15.12.2022 | | 11.776 | 11.706 | 0,09 |
| **SMFG Preferred Capital GBP 2 Ltd.** | | | | |
| 10,231 % fällig am 29.07.2049 | £ | 1.500 | 3.312 | 0,03 |
| **Stone Tower CLO VI Ltd.** | | | | |
| 0,545 % fällig am 17.04.2021 | $ | 318 | 315 | 0,00 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 02.05.2019 | | 24.700 | 25.136 | 0,20 |
| **Voya CLO III Ltd.** | | | | |
| 0,567 % fällig am 13.12.2020 | | 3.049 | 3.041 | 0,02 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 22.975 | 22.801 | 0,18 |
| **WG Horizons CLO I** | | | | |
| 0,667 % fällig am 24.05.2019 | | 645 | 642 | 0,01 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 42.475 | 37.590 | 0,29 |
| | | | 250.420 | 1,96 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 5.400 | 5.397 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | | 13.450 | 13.426 | 0,10 |
| **Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.10.2024 | | 3.400 | 3.276 | 0,03 |
| | | | 22.099 | 0,17 |
| **CHINA** | | | | |
| **Amber Circle Funding Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.12.2017 | | 38.550 | 38.493 | 0,30 |
| 3,250 % fällig am 04.12.2022 | | 36.125 | 35.952 | 0,28 |
| **CNOOC Curtis Funding No.1 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 1.800 | 1.864 | 0,01 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 2,351 % fällig am 13.11.2017 | | 12.500 | 12.543 | 0,10 |
| | | | 88.852 | 0,69 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **RPG Byty Sro** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.05.2020 | € | 6.700 | 7.606 | 0,06 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | | 23.700 | 26.428 | 0,21 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **BNP Paribas Cardif S.A.** | | | | |
| 4,032 % fällig am 29.11.2049 | | 22.800 | 23.727 | 0,19 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,804 % fällig am 07.05.2017 (a) | $ | 49.000 | 48.964 | 0,38 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | € | 5.100 | 5.693 | 0,04 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.300 | 5.446 | 0,04 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,934 % fällig am 18.11.2016 | | 25.800 | 25.811 | 0,20 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2024 | | 1.000 | 1.030 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2025 | | 12.000 | 11.533 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | | 13.200 | 12.864 | 0,10 |
| 5,150 % fällig am 21.07.2024 | | 1.200 | 1.212 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 10.350 | 10.898 | 0,08 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.06.2047 | € | 10.400 | 11.002 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 2.600 | $ 2.690 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 31.10.2049 | | 6.600 | 6.893 | 0,05 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.03.2027 | | 27.050 | 28.104 | 0,22 |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 17.350 | 19.413 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 3.700 | 5.375 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 13.150 | 13.488 | 0,11 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 15.800 | 17.476 | 0,14 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 13.10.2020 | | 9.400 | 9.264 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2049 | | 22.500 | 21.234 | 0,17 |
| 5,625 % fällig am 29.12.2049 | | 13.650 | 13.032 | 0,10 |
| **La Mondiale SAM** | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | € | 10.282 | 11.292 | 0,09 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 20.300 | 19.742 | 0,15 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.10.2049 | € | 24.400 | 26.497 | 0,21 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 03.04.2018 | $ | 350 | 357 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 12.04.2016 | | 19.434 | 19.600 | 0,15 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | € | 1.800 | 1.980 | 0,02 |
| **Solvay Finance S.A.** | | | | |
| 5,118 % fällig am 29.12.2049 | | 3.400 | 3.684 | 0,03 |
| 5,869 % fällig am 29.12.2049 | | 12.600 | 13.653 | 0,11 |
| | | | 391.954 | 3,06 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **EnBW Energie Baden-Wuerttemberg AG** | | | | |
| 7,375 % fällig am 02.04.2072 | | 2.600 | 3.000 | 0,02 |
| **KFW** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.08.2023 | | 4.300 | 5.262 | 0,04 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 8.800 | 9.889 | 0,08 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.08.2025 | | 1.450 | 1.629 | 0,01 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | | 22.000 | 23.017 | 0,18 |
| | | | 42.797 | 0,33 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | | 200 | 203 | 0,00 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 24.02.2023 | | 225 | 183 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2024 | | 225 | 178 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2025 | | 225 | 174 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2026 | | 225 | 168 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2027 | | 225 | 166 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2028 | | 225 | 162 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2029 | | 750 | 526 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2030 | | 750 | 514 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2031 | | 750 | 506 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2032 | | 750 | 494 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2033 | | 750 | 491 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2034 | | 750 | 481 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2035 | | 6.650 | 4.219 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2036 | | 1.050 | 660 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2037 | | 1.050 | 639 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2038 | | 1.050 | 653 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2039 | | 1.050 | 656 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2040 | | 1.050 | 655 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2041 | | 1.050 | 656 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2042 | | 1.500 | 938 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 669.000 | 5.005 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 03.07.2017 | | 340.000 | 2.600 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 772.000 | 6.185 | 0,05 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 9.400 | 9.496 | 0,08 |
| | | | 36.608 | 0,29 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | $ | 44.975 | 44.593 | 0,35 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 15.600 | 15.119 | 0,12 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 29.600 | 29.620 | 0,23 |
| **Credit Suisse Group Guernsey I Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | $ | 3.600 | $ 3.715 | 0,03 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | | 32.252 | 33.030 | 0,26 |
| | | | 126.077 | 0,99 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 13.03.2023 | | 9.300 | 9.065 | 0,07 |
| 3,200 % fällig am 11.03.2025 | | 400 | 387 | 0,00 |
| **CNOOC Finance 2011 Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | | 15.250 | 15.899 | 0,13 |
| **CNOOC Finance 2015 Australia Pty Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | | 35.610 | 34.846 | 0,27 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 18.600 | 18.573 | 0,15 |
| | | | 78.770 | 0,62 |
| **INDIEN** | | | | |
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | | 8.300 | 8.127 | 0,06 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,753 % fällig am 30.03.2016 | | 28.600 | 28.671 | 0,23 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.11.2016 | | 6.375 | 6.529 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2016 | | 3.600 | 3.603 | 0,03 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 2,467 % fällig am 21.01.2016 | | 5.500 | 5.499 | 0,04 |
| | | | 52.429 | 0,41 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.07.2021 | € | 2.500 | 2.694 | 0,02 |
| **IRLAND** | | | | |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | $ | 11.250 | 12.336 | 0,10 |
| **Brunswick Rail Finance Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2017 | | 11.000 | 5.005 | 0,04 |
| **Fastnet Securities 9 Ltd.** | | | | |
| 1,573 % fällig am 10.08.2053 | € | 18.979 | 21.015 | 0,16 |
| **GE Capital International Funding Co.** | | | | |
| 0,964 % fällig am 15.04.2016 | $ | 540 | 540 | 0,01 |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 8.000 | 7.939 | 0,06 |
| 3,373 % fällig am 15.11.2025 | | 12.600 | 12.844 | 0,10 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 1.885 | 1.927 | 0,02 |
| **Mercator CLO II PLC** | | | | |
| 0,149 % fällig am 18.02.2024 | € | 820 | 885 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (b)** | | 2.58 | 260.256 | 2,03 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Willow No. 2 Ireland PLC for Zurich Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.10.2045 | $ | 4.700 | 4.373 | 0,03 |
| | | | 327.120 | 2,56 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Berica 8 Residential MBS Srl** | | | | |
| 0,229 % fällig am 31.03.2048 | € | 19.735 | 21.041 | 0,17 |
| **Berica ABS Srl** | | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | | 14.899 | 16.036 | 0,13 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | $ | 32.325 | 32.341 | 0,25 |
| 3,875 % fällig am 16.01.2018 | | 3.275 | 3.360 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2019 | | 3.016 | 3.108 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 800 | 908 | 0,01 |
| **Intesa Sanpaolo Vita SpA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 17.800 | 19.314 | 0,15 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (c)** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 2.328 | 2.669 | 0,02 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 27.759 | 33.622 | 0,26 |
| | | | 132.399 | 1,04 |
| **JAPAN** | | | | |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,897 % fällig am 10.03.2017 (a) | $ | 37.500 | $ 37.462 | 0,29 |
| 2,350 % fällig am 08.09.2019 | | 15.500 | 15.438 | 0,12 |
| 2,750 % fällig am 14.09.2020 | | 15.600 | 15.614 | 0,12 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.10.2020 | | 5.000 | 5.000 | 0,04 |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 0,747 % fällig am 16.04.2017 | | 5.750 | 5.734 | 0,05 |
| 1,300 % fällig am 16.04.2017 | | 29.000 | 28.867 | 0,23 |
| 1,550 % fällig am 17.10.2017 | | 3.850 | 3.821 | 0,03 |
| 2,150 % fällig am 20.10.2018 | | 4.000 | 3.987 | 0,03 |
| **Nippon Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.10.2042 | | 17.600 | 18.458 | 0,14 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.09.2016 | | 31.500 | 31.632 | 0,25 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,436 % fällig am 02.04.2024 | | 5.550 | 5.712 | 0,04 |
| | | | 171.725 | 1,34 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 3,781 % fällig am 31.07.2019 | £ | 6.300 | 9.405 | 0,08 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2020 | | 5.000 | 7.550 | 0,06 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 38.000 | 42.562 | 0,33 |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | | 4.405 | 5.094 | 0,04 |
| **Delphi Automotive PLC** | | | | |
| 3,150 % fällig am 19.11.2020 | $ | 12.900 | 12.898 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 15.01.2026 | | 1.400 | 1.409 | 0,01 |
| **Petrofac Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 10.10.2018 | | 3.000 | 2.851 | 0,02 |
| | | | 81.769 | 0,64 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,289 % fällig am 01.09.2016 | | 61.600 | 61.648 | 0,48 |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | | 5.300 | 5.320 | 0,04 |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 | | 800 | 804 | 0,01 |
| 1,850 % fällig am 01.03.2017 | | 16.300 | 16.334 | 0,13 |
| 2,350 % fällig am 12.03.2018 | | 3.800 | 3.806 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | | 12.500 | 12.521 | 0,10 |
| 3,450 % fällig am 15.03.2022 | | 9.268 | 9.291 | 0,07 |
| 3,800 % fällig am 15.03.2025 | | 9.000 | 8.971 | 0,07 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 1.500 | 1.530 | 0,01 |
| **Delos Finance Sarl** | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.03.2021 | $ | 16.900 | 16.860 | 0,13 |
| **Endo Luxembourg Finance I Co. Sarl** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.09.2022 | | 4.450 | 4.399 | 0,03 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 2,933 % fällig am 26.04.2018 | € | 6.150 | 6.517 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | $ | 7.900 | 7.016 | 0,05 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 42.400 | 47.470 | 0,37 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.04.2023 | | 25.475 | 22.673 | 0,18 |
| **Matterhorn Telecom S.A.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.05.2022 | CHF | 8.600 | 7.861 | 0,06 |
| **Penta CLO 1 S.A.** | | | | |
| 0,172 % fällig am 04.06.2024 | € | 4.142 | 4.458 | 0,04 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | $ | 52.350 | 53.330 | 0,42 |
| | | | 290.809 | 2,27 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 13.150 | 14.005 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 2.300 | 2.536 | 0,02 |
| **Cemex SAB de C.V.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 11.01.2025 | | 2.000 | 1.677 | 0,01 |
| **Desarrolladora Homex SAB de C.V.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 11.12.2019 (d) | | 2.900 | 58 | 0,00 |
| | | | 18.276 | 0,14 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | $ | 13.400 | $ 13.307 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | | 8.950 | 8.938 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 13.09.2022 | | 350 | 368 | 0,00 |
| **Amaya Holdings BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2021 | | 11.905 | 11.151 | 0,09 |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | € | 713 | 768 | 0,01 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 3,375 % fällig am 21.05.2025 | $ | 6.850 | 6.796 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 57.950 | 75.069 | 0,59 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 22.400 | 23.114 | 0,18 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 11.950 | 12.872 | 0,10 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | | 37.112 | 45.954 | 0,36 |
| **CRH Funding BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2024 | € | 4.100 | 4.481 | 0,04 |
| **Demeter Investments BV for Swiss Re Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2050 | $ | 11.500 | 11.509 | 0,09 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2016 | | 2.010 | 2.029 | 0,02 |
| **EMF-NL Prime** | | | | |
| 0,748 % fällig am 17.04.2041 | € | 1.657 | 1.676 | 0,01 |
| **Eurosail-NL BV** | | | | |
| 1,448 % fällig am 17.10.2040 | | 844 | 910 | 0,01 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 26.11.2018 | $ | 4.050 | 4.036 | 0,03 |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | | 8.150 | 8.869 | 0,07 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 5.900 | 5.793 | 0,05 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.09.2018 | € | 6.300 | 6.918 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 22.01.2019 | $ | 29.800 | 29.437 | 0,23 |
| 3,000 % fällig am 23.10.2017 | | 17.100 | 17.159 | 0,13 |
| **LyondellBasell Industries NV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 26.02.2055 | | 1.300 | 1.058 | 0,01 |
| **Netherlands Government Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2016 | € | 25 | 28 | 0,00 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 18.03.2022 | | 400 | 425 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | | 13.450 | 14.406 | 0,11 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.12.2020 | $ | 10.800 | 10.766 | 0,08 |
| **Rhodium BV** | | | | |
| 0,496 % fällig am 27.05.2084 | € | 251 | 271 | 0,00 |
| **RWE Finance BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 500 | 836 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 2.200.000 | 2.667 | 0,02 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Storm BV** | | | | |
| 0,658 % fällig am 22.08.2054 | € | 140 | 153 | 0,00 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | | 13.250 | 13.648 | 0,11 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.08.2017 | NOK | 1.000 | 115 | 0,00 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.12.2023 | € | 4.700 | 5.081 | 0,04 |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 30.450 | 30.757 | 0,24 |
| **Wood Street CLO 1 BV** | | | | |
| 0,231 % fällig am 22.11.2021 | € | 2.310 | 2.501 | 0,02 |
| | | | 373.866 | 2,92 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 3,200 % fällig am 03.04.2017 | $ | 160 | 163 | 0,00 |
| **Statoil ASA** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.03.2024 | | 5.361 | 5.441 | 0,04 |
| | | | 5.604 | 0,04 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 | € | 500 | 74 | 0,00 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | € | 3.937 | $ 3.723 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 8.800 | 8.558 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 2.100 | 2.064 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 8.600 | 8.992 | 0,07 |
| | | | 23.411 | 0,18 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **Flextronics International Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2025 | $ | 7.000 | 6.834 | 0,05 |
| **Global Logistic Properties Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | | 22.200 | 21.768 | 0,17 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2024 | | 10.782 | 11.004 | 0,09 |
| | | | 39.606 | 0,31 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.10.2017 | € | 9.800 | 10.976 | 0,09 |
| 4,125 % fällig am 18.02.2019 | $ | 200 | 211 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 16.600 | 18.353 | 0,14 |
| | | | 29.540 | 0,23 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,750 % fällig am 27.02.2018 | | 7.200 | 7.136 | 0,06 |
| 2,625 % fällig am 30.12.2020 | | 20.200 | 20.225 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 11.01.2017 | | 34.200 | 34.953 | 0,27 |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.06.2017 | | 3.500 | 3.555 | 0,03 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.05.2017 | | 7.300 | 7.492 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 16.11.2021 | | 300 | 330 | 0,00 |
| | | | 73.691 | 0,58 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2018 | € | 1.100 | 1.329 | 0,01 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 13.000 | 13.311 | 0,10 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 300 | 306 | 0,00 |
| **Inmobiliaria Colonial S.A.** | | | | |
| 1,863 % fällig am 05.06.2019 | | 9.800 | 10.737 | 0,08 |
| 2,728 % fällig am 05.06.2023 | | 8.500 | 9.158 | 0,07 |
| **Junta de Castilla y Leon** | | | | |
| 6,270 % fällig am 19.02.2018 | | 3.300 | 4.028 | 0,03 |
| 6,505 % fällig am 01.03.2019 | | 7.100 | 9.138 | 0,07 |
| **Santander Issuances SAU** | | | | |
| 0,729 % fällig am 30.09.2019 | | 4.600 | 4.909 | 0,04 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 1,243 % fällig am 23.06.2017 | $ | 33.300 | 33.121 | 0,26 |
| 3,992 % fällig am 16.02.2016 | | 31.899 | 31.988 | 0,25 |
| 5,289 % fällig am 09.12.2022 | £ | 450 | 733 | 0,01 |
| 6,221 % fällig am 03.07.2017 | $ | 1.000 | 1.063 | 0,01 |
| 6,421 % fällig am 20.06.2016 | | 17.100 | 17.495 | 0,14 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 5,763 % fällig am 03.04.2017 | € | 11.500 | 13.338 | 0,11 |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | | 3.000 | 3.692 | 0,03 |
| | | | 154.346 | 1,21 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 2,500 % fällig am 17.09.2020 | $ | 32.450 | 32.293 | 0,25 |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 8.350 | 8.185 | 0,06 |
| **Perstorp Holding AB** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.05.2017 | € | 1.950 | 2.142 | 0,02 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.10.2020 | $ | 26.850 | 26.680 | 0,21 |
| | | | 69.300 | 0,54 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 2,300 % fällig am 28.05.2019 | | 5.750 | 5.758 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 09.09.2024 | | 11.150 | 11.250 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | | 47.252 | 51.023 | 0,40 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 3.100 | $ 3.268 | 0,03 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 14.08.2017 | | 4.500 | 4.473 | 0,03 |
| 2,375 % fällig am 14.08.2019 | | 900 | 900 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | | 40.880 | 41.608 | 0,32 |
| 4,750 % fällig am 12.02.2026 | € | 5.650 | 6.565 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 51.400 | 52.043 | 0,41 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 8.850 | 9.259 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 58.356 | 66.614 | 0,52 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 18.800 | 21.475 | 0,17 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 7.900 | 8.374 | 0,07 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | | 14.000 | 14.700 | 0,11 |
| | | | 297.310 | 2,32 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2027 | | 8.404 | 8.078 | 0,06 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **DP World Ltd.** | | | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 5.000 | 4.938 | 0,04 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Anglo American Capital PLC** | | | | |
| 1,271 % fällig am 15.04.2016 | | 2.800 | 2.773 | 0,02 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 16.08.2019 | £ | 450 | 745 | 0,01 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | $ | 2.348 | 2.509 | 0,02 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 13.592 | 25.885 | 0,20 |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | $ | 12.390 | 16.078 | 0,13 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 15.100 | 28.830 | 0,23 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 11.400 | 16.836 | 0,13 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 (a) | $ | 33.400 | 34.427 | 0,27 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | | 9.775 | 10.337 | 0,08 |
| **BUPA Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.06.2021 | £ | 350 | 530 | 0,00 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 8.900 | 14.320 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 400 | 647 | 0,01 |
| **Experian Finance PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.06.2017 | $ | 1.100 | 1.096 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | | 3.690 | 3.480 | 0,03 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.07.2023 | £ | 4.500 | 7.738 | 0,06 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.03.2022 | $ | 3.536 | 3.715 | 0,03 |
| 5,100 % fällig am 05.04.2021 | | 10.900 | 12.127 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 41.790 | 44.863 | 0,35 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | £ | 2.900 | 5.037 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 19.700 | 21.595 | 0,17 |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 8.300 | 8.310 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2037 | | 200 | 241 | 0,00 |
| 6,800 % fällig am 01.06.2038 | | 6.000 | 7.492 | 0,06 |
| 7,350 % fällig am 27.11.2032 | | 8.850 | 11.049 | 0,09 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 2,050 % fällig am 11.02.2018 | | 8.300 | 8.267 | 0,06 |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 25.000 | 25.075 | 0,20 |
| 3,750 % fällig am 21.07.2022 | | 12.400 | 12.467 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 21.07.2025 | | 20.000 | 20.334 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 22.11.2016 | £ | 12.600 | 19.254 | 0,15 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 15.000 | 22.046 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 09.12.2016 | | 9.200 | 14.149 | 0,11 |
| **ITV PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.09.2022 | € | 9.300 | 10.165 | 0,08 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 09.12.2019 | £ | 100 | 150 | 0,00 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 7.800 | 15.647 | 0,12 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | € | 4.200 | 6.536 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 17.03.2020 | $ | 7.200 | $ 7.159 | 0,06 |
| 7,625 % fällig am 22.04.2025 | £ | 2.200 | 4.160 | 0,03 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 30.04.2049 | $ | 3.296 | 3.518 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 94.896 | 146.840 | 1,15 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 421 | 659 | 0,01 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,033 % fällig am 15.12.2030 | | 1.189 | 1.576 | 0,01 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 03.04.2017 | € | 1.500 | 1.737 | 0,01 |
| **Pearson Dollar Finance Two PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 06.05.2018 | $ | 1.600 | 1.728 | 0,01 |
| **Pirelli International PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.11.2019 | € | 14.200 | 15.236 | 0,12 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | $ | 700 | 777 | 0,01 |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | | 1.700 | 1.976 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 13.450 | 14.038 | 0,11 |
| **Safeway Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.12.2018 | £ | 13.361 | 21.478 | 0,17 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.10.2020 | $ | 3.950 | 3.931 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 12.025 | 18.048 | 0,14 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 16.01.2026 | | 5.000 | 7.623 | 0,06 |
| **Sky PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.11.2022 | $ | 400 | 389 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 16.09.2024 | | 8.700 | 8.513 | 0,07 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 1,139 % fällig am 28.12.2028 | £ | 331 | 388 | 0,00 |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | | 80 | 110 | 0,00 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 239 | 369 | 0,00 |
| **SSE PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.09.2049 | $ | 24.900 | 25.986 | 0,20 |
| **Tenterden Funding PLC** | | | | |
| 2,085 % fällig am 21.03.2044 | £ | 5.537 | 8.243 | 0,06 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 2.751 | 3.822 | 0,03 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2025 | | 4.500 | 6.516 | 0,05 |
| | | | 739.570 | 5,78 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Loan tot Learn Education Loan Trust** | | | | |
| 0,671 % fällig am 15.06.2031 | $ | 6.495 | 6.094 | 0,05 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 26.02.2029 | | 3.500 | 3.277 | 0,02 |
| 0,692 % fällig am 26.03.2029 | | 510 | 468 | 0,00 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 15.03.2024 | | 729 | 720 | 0,01 |
| 0,752 % fällig am 16.12.2041 | | 4.000 | 3.523 | 0,03 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,081 % fällig am 16.10.2023 | | 1.063 | 1.060 | 0,01 |
| 2,081 % fällig am 15.06.2045 | | 4.000 | 4.032 | 0,03 |
| 3,581 % fällig am 16.05.2044 | | 285 | 295 | 0,00 |
| | | | 19.469 | 0,15 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.10.2020 | | 7.120 | 7.124 | 0,06 |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | | 63.500 | 62.821 | 0,49 |
| **AWAS Leasing 2011-I Ltd.** | | | | |
| 4,870 % fällig am 02.10.2021 (i) | | 44.919 | 46.126 | 0,36 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | | 11.409 | 11.204 | 0,09 |
| **Chemours Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.05.2022 | | 7.214 | 6.637 | 0,05 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 129.713 | 128.902 | 1,01 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 24.013 | 23.963 | 0,19 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 23.697 | 23.584 | 0,18 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | $ | 115.148 | $ 114.950 | 0,90 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 21.921 | 21.924 | 0,17 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 34.191 | 34.161 | 0,27 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 169.008 | 167.166 | 1,31 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 5.831 | 5.694 | 0,04 |
| **RPI Finance Trust** | | | | |
| 3,250 % fällig am 09.11.2018 | | 10.470 | 10.453 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 09.11.2020 | | 46.883 | 46.717 | 0,37 |
| **Texas Competitive Electric Holdings Co. LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.11.2016 | | 1.919 | 1.909 | 0,01 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.11.2022 | | 8.000 | 8.009 | 0,06 |
| **WR Grace & Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.02.2021 | | 49.517 | 49.207 | 0,38 |
| | | | 770.551 | 6,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **21st Century Fox America, Inc.** | | | | |
| 6,150 % fällig am 15.02.2041 | | 2.900 | 3.270 | 0,03 |
| 9,500 % fällig am 15.07.2024 | | 4.000 | 5.458 | 0,04 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | | 33.000 | 32.702 | 0,26 |
| 3,200 % fällig am 06.11.2022 | | 600 | 591 | 0,00 |
| **ACE INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 03.05.2026 | | 11.600 | 11.579 | 0,09 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2026 | | 10.150 | 10.029 | 0,08 |
| 4,600 % fällig am 01.04.2022 | | 10.941 | 11.365 | 0,09 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 05.12.2021 | | 12.600 | 12.982 | 0,10 |
| 3,800 % fällig am 05.12.2024 | | 9.900 | 10.318 | 0,08 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.10.2020 | | 2.975 | 2.974 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.04.2023 | | 7.450 | 7.339 | 0,06 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 01.09.2066 | | 3.000 | 3.030 | 0,02 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 14.09.2020 | | 17.300 | 17.351 | 0,14 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 13.160 | 13.022 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2025 | | 15.000 | 14.773 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2018 | | 8.245 | 8.603 | 0,07 |
| 5,050 % fällig am 01.09.2020 | | 3.700 | 3.999 | 0,03 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2043 | | 13.000 | 13.862 | 0,11 |
| **Anadarko Petroleum Corp.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.09.2016 | | 420 | 432 | 0,00 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,023 % fällig am 30.03.2017 | | 12.950 | 12.921 | 0,10 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 45.000 | 43.335 | 0,34 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.06.2025 | | 625 | 618 | 0,00 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.09.2016 | | 200 | 202 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 31.01.2018 | | 4.850 | 4.953 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2021 | | 2.500 | 2.803 | 0,02 |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 29.545 | 33.866 | 0,26 |
| **Aviation Loan Trust 2013-2** | | | | |
| 2,622 % fällig am 15.09.2021 | | 6.449 | 5.974 | 0,05 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 13.000 | 807 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 01.04.2019 | $ | 7.100 | 7.123 | 0,06 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | | 925 | 958 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 1.150 | 1.190 | 0,01 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | | 51.620 | 55.538 | 0,43 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 35.200 | 37.721 | 0,29 |
| 6,500 % fällig am 01.08.2016 | | 3.725 | 3.834 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 171.426 | 189.229 | 1,48 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,764 % fällig am 08.05.2017 | | 17.350 | 17.313 | 0,14 |
| 0,812 % fällig am 15.06.2017 | | 12.161 | 12.067 | 0,09 |
| 0,832 % fällig am 14.11.2016 | $ | 15.600 | $ 15.595 | 0,12 |
| 0,832 % fällig am 14.02.2017 | | 1.040 | 1.039 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.03.2017 | | 12.202 | 12.697 | 0,10 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 27.11.2020 | | 15.800 | 15.741 | 0,12 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 02.10.2017 | | 32.770 | 35.300 | 0,28 |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 129.495 | 142.886 | 1,12 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 09.12.2019 | | 27.200 | 28.245 | 0,22 |
| **Biogen, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.09.2020 | | 3.000 | 2.995 | 0,02 |
| 4,050 % fällig am 15.09.2025 | | 6.600 | 6.643 | 0,05 |
| **BioMed Realty LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2022 | | 6.100 | 6.071 | 0,05 |
| **BMW US Capital LLC** | | | | |
| 0,756 % fällig am 02.06.2017 | | 15.000 | 14.911 | 0,12 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2022 | | 11.600 | 11.460 | 0,09 |
| 3,850 % fällig am 15.05.2025 | | 9.300 | 9.169 | 0,07 |
| **Bruce Mansfield Unit 1 2007 Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,850 % fällig am 01.06.2034 | | 2.928 | 2.945 | 0,02 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 5.599 | 1.792 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 2.297 | 706 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 21.182 | 11.200 | 0,09 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 19.430 | 21.360 | 0,17 |
| **CBS Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2026 | | 4.900 | 4.788 | 0,04 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 21.000 | 20.950 | 0,16 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 58.500 | 58.531 | 0,46 |
| 6,484 % fällig am 23.10.2045 | | 5.500 | 5.523 | 0,04 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 6.425 | 1.815 | 0,01 |
| **Chevron Corp.** | | | | |
| 1,344 % fällig am 09.11.2017 | | 7.000 | 6.986 | 0,05 |
| **CITGO Petroleum Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.08.2022 | | 4.050 | 3.908 | 0,03 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,013 % fällig am 27.04.2018 | | 10.000 | 9.965 | 0,08 |
| 1,027 % fällig am 10.03.2017 | | 18.390 | 18.351 | 0,14 |
| 1,700 % fällig am 27.04.2018 | | 1.450 | 1.436 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 20.300 | 20.158 | 0,16 |
| 5,125 % fällig am 12.12.2018 | £ | 500 | 788 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 13.02.2017 | AUD | 2.900 | 2.186 | 0,02 |
| 8,125 % fällig am 15.07.2039 | $ | 780 | 1.122 | 0,01 |
| **CNO Financial Group, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.05.2025 | | 8.200 | 8.374 | 0,07 |
| **Columbia Property Trust Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.04.2025 | | 5.200 | 5.152 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 01.04.2018 | | 17.000 | 18.127 | 0,14 |
| **Comcast Cable Communications Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,455 % fällig am 15.11.2022 | | 5.950 | 8.221 | 0,06 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.08.2045 | | 800 | 812 | 0,01 |
| **Continental Airlines 2001-1 Class A-1 Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,703 % fällig am 15.06.2021 | | 168 | 175 | 0,00 |
| **Continental Airlines 2009-1 Pass-Through Trust** | | | | |
| 9,000 % fällig am 08.07.2016 | | 23.490 | 24.259 | 0,19 |
| **Continental Airlines 2009-2 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.11.2019 | | 33.825 | 38.163 | 0,30 |
| **Continental Airlines 2012-2 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.10.2024 | | 2.870 | 2.946 | 0,02 |
| **Continental Airlines 2012-2 Class B Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.10.2020 | | 10.605 | 10.936 | 0,09 |
| **Cox Communications, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2016 | | 4.215 | 4.359 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 01.06.2018 | | 500 | 538 | 0,00 |
| **CRH America, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.05.2025 | | 7.300 | 7.263 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 18.05.2045 | | 5.000 | 5.022 | 0,04 |
| **Crown Castle Towers LLC** | | | | |
| 3,222 % fällig am 15.05.2022 | | 7.000 | 6.915 | 0,05 |
| 4,174 % fällig am 15.08.2017 | | 18.100 | 18.527 | 0,14 |
| 5,495 % fällig am 15.01.2017 | | 24.000 | 24.353 | 0,19 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 20.07.2035 | $ | 30.000 | $ 31.071 | 0,24 |
| 5,125 % fällig am 20.07.2045 | | 12.500 | 13.219 | 0,10 |
| **Daimler Finance N.A. LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.09.2021 | | 3.800 | 3.950 | 0,03 |
| **Delta Air Lines 2009-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,750 % fällig am 17.12.2019 | | 8.193 | 9.207 | 0,07 |
| **Delta Air Lines 2009-1 Series B Pass-Through Trust** | | | | |
| 9,750 % fällig am 17.12.2016 | | 393 | 417 | 0,00 |
| **Denali Borrower LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2020 | | 3.800 | 3.990 | 0,03 |
| **Devon Energy Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2022 | | 1.700 | 1.447 | 0,01 |
| **Digital Delta Holdings LLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.10.2020 | | 15.200 | 15.233 | 0,12 |
| 4,750 % fällig am 01.10.2025 | | 2.000 | 2.022 | 0,02 |
| **Doctors Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | | 17.850 | 19.187 | 0,15 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2017 | | 3.700 | 3.743 | 0,03 |
| **EMD Finance LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.03.2025 | | 1.800 | 1.709 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.06.2018 | | 1.250 | 1.198 | 0,01 |
| 4,050 % fällig am 15.03.2025 | | 17.970 | 14.785 | 0,12 |
| 4,650 % fällig am 01.06.2021 | | 3.800 | 3.572 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2026 | | 32.300 | 27.219 | 0,21 |
| 5,200 % fällig am 01.02.2022 | | 10.000 | 9.354 | 0,07 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2022 | | 3.200 | 3.269 | 0,03 |
| **Entergy New Orleans, Inc.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 01.12.2020 | | 15.000 | 15.264 | 0,12 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.03.2023 | | 4.962 | 4.494 | 0,04 |
| 3,700 % fällig am 15.02.2026 | | 5.480 | 4.926 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2025 | | 2.450 | 2.245 | 0,02 |
| 3,900 % fällig am 15.02.2024 | | 5.100 | 4.766 | 0,04 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.04.2025 | | 6.000 | 5.714 | 0,04 |
| **EQT Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 3.015 | 2.490 | 0,02 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2025 | | 1.000 | 964 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2024 | | 6.500 | 6.506 | 0,05 |
| **Exeter Finance Corp.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 20.05.2019 | | 8.000 | 7.858 | 0,06 |
| **Federal Express Corporation 2012 Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.01.2018 | | 4.122 | 4.142 | 0,03 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 35.508 | 37.738 | 0,29 |
| 6,600 % fällig am 15.05.2017 | | 4.530 | 4.781 | 0,04 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.10.2018 | | 8.800 | 8.837 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 15.10.2020 | | 28.000 | 28.395 | 0,22 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.02.2023 | | 2.185 | 2.176 | 0,02 |
| 4,600 % fällig am 15.11.2024 | | 2.000 | 2.028 | 0,02 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.03.2018 | | 10.000 | 10.051 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | | 14.641 | 14.918 | 0,12 |
| **FirstEnergy Transmission LLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.01.2025 | | 800 | 812 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2016 | | 25.500 | 25.506 | 0,20 |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | | 18.100 | 18.056 | 0,14 |
| 3,984 % fällig am 15.06.2016 | | 1.600 | 1.618 | 0,01 |
| 4,207 % fällig am 15.04.2016 | | 21.140 | 21.311 | 0,17 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2016 | | 14.800 | 15.653 | 0,12 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2020 | | 16.900 | 16.825 | 0,13 |
| **FPL Energy National Wind Portfolio LLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 25.03.2019 | | 39 | 39 | 0,00 |
| **Freeport Minerals Corp.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 01.06.2031 | | 1.800 | 1.429 | 0,01 |
| **Freeport-McMoran Oil & Gas LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2021 | | 2.100 | 1.286 | 0,01 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2067 | $ | 1.350 | $ 1.413 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 530 | 724 | 0,01 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.10.2018 | | 6.700 | 6.784 | 0,05 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.01.2020 | | 600 | 595 | 0,00 |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | | 19.850 | 19.565 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2018 | | 550 | 553 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2025 | | 30.850 | 29.324 | 0,23 |
| 4,375 % fällig am 25.09.2021 | | 1.700 | 1.726 | 0,01 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2023 | | 11.550 | 9.298 | 0,07 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 23.01.2025 | | 3.000 | 2.954 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 3.200 | 3.228 | 0,03 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | | 10.000 | 10.223 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 27.07.2021 | | 29.810 | 32.999 | 0,26 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 13.318 | 14.644 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 24.01.2022 | | 12.800 | 14.575 | 0,11 |
| 5,950 % fällig am 18.01.2018 | | 20.656 | 22.257 | 0,17 |
| 6,150 % fällig am 01.04.2018 | | 13.950 | 15.157 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2019 (a) | | 40.100 | 45.917 | 0,36 |
| **GTP Acquisition Partners I LLC** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.06.2020 | | 22.700 | 22.041 | 0,17 |
| **Gulfstream Natural Gas System LLC** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.09.2025 | | 5.000 | 4.755 | 0,04 |
| 6,950 % fällig am 01.06.2016 | | 929 | 947 | 0,01 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2022 | | 12.600 | 12.411 | 0,10 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 700 | 700 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 18.850 | 20.584 | 0,16 |
| **HCP, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.02.2016 | | 7.000 | 7.010 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2022 | | 9.300 | 9.271 | 0,07 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 05.10.2017 | | 16.400 | 16.393 | 0,13 |
| **Hiland Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.05.2022 | | 5.500 | 5.290 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 01.10.2020 | | 58.867 | 59.529 | 0,47 |
| **Home Depot, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.06.2022 | | 3.000 | 2.999 | 0,02 |
| **Hospitality Properties Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 9.395 | 9.663 | 0,08 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.725 | 1.657 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2023 | | 4.000 | 4.140 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2021 | | 4.450 | 4.930 | 0,04 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2021 | | 4.250 | 4.356 | 0,03 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | | 11.470 | 11.451 | 0,09 |
| 6,676 % fällig am 15.01.2021 | | 20.951 | 24.071 | 0,19 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 05.03.2020 | | 10.650 | 10.532 | 0,08 |
| 2,750 % fällig am 07.08.2020 | | 12.800 | 12.809 | 0,10 |
| **Illinois Power Generating Co.** | | | | |
| 6,300 % fällig am 01.04.2020 | | 1.900 | 1.149 | 0,01 |
| **Intel Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 29.07.2025 | | 23.200 | 24.025 | 0,19 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2020 | | 5.000 | 5.002 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 01.12.2025 | | 3.900 | 3.915 | 0,03 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 9.825 | 10.107 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 24.400 | 26.809 | 0,21 |
| **International Paper Co.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2022 | | 1.745 | 1.866 | 0,01 |
| **iStar, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.11.2017 | | 2.000 | 1.966 | 0,02 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.02.2017 | | 33.400 | 33.318 | 0,26 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2022 | | 7.900 | 6.675 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 24.025 | 21.442 | 0,17 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2021 | | 5.325 | 4.706 | 0,04 |
| **Jefferies LoanCore LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ | 13.850 | $ 13.296 | 0,10 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 18.900 | 18.996 | 0,15 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2020 | | 700 | 743 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2018 | | 29.349 | 31.708 | 0,25 |
| 6,300 % fällig am 23.04.2019 | | 42.852 | 48.072 | 0,38 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 0,832 % fällig am 13.06.2016 | | 8.250 | 8.239 | 0,06 |
| 0,836 % fällig am 02.06.2017 (a) | | 36.700 | 36.584 | 0,29 |
| 5,375 % fällig am 28.09.2016 | £ | 2.200 | 3.344 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | $ | 34.832 | 37.250 | 0,29 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.01.2023 | | 1.800 | 1.786 | 0,01 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.09.2022 | | 4.200 | 3.661 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.09.2024 | | 17.200 | 14.656 | 0,11 |
| 5,950 % fällig am 15.02.2018 | | 3.500 | 3.590 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2017 | | 14.840 | 15.017 | 0,12 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 01.12.2019 | | 5.750 | 5.327 | 0,04 |
| 4,300 % fällig am 01.06.2025 | | 11.700 | 10.128 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | | 150 | 143 | 0,00 |
| 5,050 % fällig am 15.02.2046 | | 1.000 | 744 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 92 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 15.06.2017 | | 400 | 412 | 0,00 |
| 7,420 % fällig am 15.02.2037 | | 3.700 | 3.426 | 0,03 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 01.11.2024 | | 7.000 | 7.055 | 0,06 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | € | 4.700 | 5.166 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | $ | 1.100 | 1.109 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2025 | | 8.700 | 8.798 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 6.550 | 9.869 | 0,08 |
| **Laclede Group, Inc.** | | | | |
| 1,112 % fällig am 15.08.2017 | $ | 11.460 | 11.408 | 0,09 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 6,850 % fällig am 15.06.2017 | | 3.553 | 3.784 | 0,03 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc. (d)** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2013 | € | 2.807 | 305 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 30.12.2016 | $ | 900 | 68 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 02.05.2018 | | 3.000 | 229 | 0,00 |
| **Lender Processing Services, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.04.2023 | | 819 | 847 | 0,01 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.03.2026 | | 5.000 | 5.017 | 0,04 |
| 4,050 % fällig am 15.10.2023 | | 4.200 | 4.347 | 0,03 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 01.04.2025 | | 15.000 | 14.737 | 0,12 |
| 5,850 % fällig am 15.03.2017 | | 16.772 | 17.495 | 0,14 |
| 5,950 % fällig am 15.03.2022 | | 17.500 | 18.944 | 0,15 |
| 6,125 % fällig am 03.10.2016 | | 30.555 | 31.547 | 0,25 |
| 6,625 % fällig am 15.04.2018 | | 1.450 | 1.570 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2020 | | 5.020 | 5.811 | 0,05 |
| **MassMutual Global Funding II** | | | | |
| 2,350 % fällig am 09.04.2019 | | 200 | 201 | 0,00 |
| **Medtronic, Inc.** | | | | |
| 1,312 % fällig am 15.03.2020 | | 8.300 | 8.284 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 15.03.2020 | | 1.470 | 1.481 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2025 | | 12.900 | 13.021 | 0,10 |
| **MetLife Capital Trust IV** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.12.2037 | | 2.882 | 3.530 | 0,03 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 1,950 % fällig am 03.12.2018 | | 4.850 | 4.840 | 0,04 |
| 2,300 % fällig am 10.04.2019 (a) | | 3.500 | 3.502 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 28.09.2017 | AUD | 28.250 | 21.097 | 0,16 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 8,625 % fällig am 01.02.2019 | $ | 4.136 | 4.603 | 0,04 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2024 | | 400 | 393 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2025 | | 2.000 | 1.991 | 0,02 |
| 6,050 % fällig am 01.09.2016 | | 4.925 | 5.053 | 0,04 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 19.780 | 18.544 | 0,14 |
| **Midwest Generation LLC** | | | | |
| 8,560 % fällig am 02.01.2016 | | 45 | 45 | 0,00 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2019 | | 10.550 | 10.648 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Morgan Stanley** | | | |
| 0,765 % fällig am 18.10.2016 | $ 1.720 | $ 1.717 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 27.01.2045 | 7.000 | 6.706 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 26.01.2020 | 1.950 | 2.149 | 0,02 |
| 5,950 % fällig am 28.12.2017 (a) | 46.375 | 49.892 | 0,39 |
| 6,250 % fällig am 28.08.2017 | 11.890 | 12.736 | 0,10 |
| 7,300 % fällig am 13.05.2019 | 1.075 | 1.236 | 0,01 |
| **Motorola Solutions, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2024 | 19.700 | 17.126 | 0,13 |
| **MUFG Union Bank N.A.** | | | |
| 0,734 % fällig am 05.05.2017 | 22.300 | 22.200 | 0,17 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 25.09.2017 | 21.380 | 21.113 | 0,16 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | 20.153 | 21.261 | 0,17 |
| **Newfield Exploration Co.** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.01.2026 | 700 | 583 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2022 | 13.350 | 11.882 | 0,09 |
| **Northwest Airlines 2001-1 Class A-1 Pass-Through Trust** | | | |
| 7,041 % fällig am 01.04.2022 | 385 | 435 | 0,00 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2025 | 4.500 | 4.399 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 01.04.2024 | 1.000 | 1.012 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | 9.900 | 10.124 | 0,08 |
| **OMX Timber Finance Investments I LLC** | | | |
| 5,420 % fällig am 29.01.2020 | 23.800 | 25.918 | 0,20 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2019 | 4.500 | 4.573 | 0,04 |
| **Owens Corning** | | | |
| 4,200 % fällig am 15.12.2022 | 8.887 | 8.905 | 0,07 |
| **Parsley Energy LLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | 500 | 480 | 0,00 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | |
| 2,875 % fällig am 17.07.2018 | 1.000 | 1.007 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 15.03.2018 | 100 | 102 | 0,00 |
| **Pfizer, Inc.** | | | |
| 5,200 % fällig am 12.08.2020 (a) | 9.962 | 11.165 | 0,09 |
| 5,800 % fällig am 12.08.2023 | 3.638 | 4.258 | 0,03 |
| **PHH Corp.** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | 900 | 824 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 01.09.2019 | 2.200 | 2.191 | 0,02 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 10.11.2044 | 1.000 | 968 | 0,01 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | 6.350 | 5.870 | 0,05 |
| 4,450 % fällig am 15.01.2026 | 3.600 | 3.248 | 0,03 |
| 6,650 % fällig am 15.03.2017 | 54.095 | 55.867 | 0,44 |
| **Piper Jaffray Cos.** | | | |
| 3,607 % fällig am 31.05.2017 | 19.000 | 18.990 | 0,15 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 2,850 % fällig am 31.01.2023 | 1.800 | 1.487 | 0,01 |
| **PNC Bank N.A.** | | | |
| 2,600 % fällig am 21.07.2020 | 3.300 | 3.301 | 0,03 |
| **Prologis LP** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2018 | 3.400 | 3.517 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 15.08.2023 | 2.400 | 2.529 | 0,02 |
| **Protective Life Global Funding** | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2020 | 21.100 | 21.102 | 0,16 |
| **Public Service Co. of Oklahoma** | | | |
| 6,150 % fällig am 01.08.2016 | 900 | 924 | 0,01 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | |
| 0,920 % fällig am 20.05.2020 | 8.200 | 8.039 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 20.05.2020 | 425 | 421 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 20.05.2022 | 275 | 272 | 0,00 |
| 3,450 % fällig am 20.05.2025 | 12.100 | 11.620 | 0,09 |
| **QVC, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | 3.600 | 3.422 | 0,03 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2025 | 100 | 93 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | 20.000 | 19.964 | 0,16 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | 800 | 721 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | 400 | 391 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | 11.600 | 10.948 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2021 | 1.300 | 1.313 | 0,01 |
| **Reliance Standard Life Global Funding II** | | | |
| 2,500 % fällig am 24.04.2019 | 21.200 | 21.127 | 0,16 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 12.06.2018 | 8.600 | 8.659 | 0,07 |
| 4,450 % fällig am 12.06.2025 | $ 17.650 | $ 18.494 | 0,14 |
| 4,850 % fällig am 15.09.2023 | 5.500 | 5.889 | 0,05 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 21.000 | 15.566 | 0,12 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-3** | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | 250 | 184 | 0,00 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | 4.493 | 4.156 | 0,03 |
| 6,850 % fällig am 15.07.2018 | 10.572 | 10.413 | 0,08 |
| **Rohm & Haas Co.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.09.2017 | 431 | 459 | 0,00 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | 18.100 | 15.973 | 0,12 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | 5.000 | 4.250 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | 10.100 | 8.838 | 0,07 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | |
| 2,650 % fällig am 17.04.2020 | 450 | 442 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | 7.250 | 7.394 | 0,06 |
| **SBA Tower Trust** | | | |
| 3,598 % fällig am 15.04.2018 | 3.200 | 3.194 | 0,02 |
| 5,101 % fällig am 17.04.2017 | 36.070 | 36.559 | 0,29 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | 21.500 | 21.788 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2018 | 6.000 | 6.299 | 0,05 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2020 | 3.100 | 3.622 | 0,03 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | |
| 3,400 % fällig am 03.12.2020 | 15.000 | 14.896 | 0,12 |
| 4,450 % fällig am 03.12.2025 | 15.800 | 15.619 | 0,12 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | |
| 4,100 % fällig am 15.03.2022 | 2.122 | 1.337 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 01.02.2018 | 18.109 | 15.415 | 0,12 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2025 | 4.040 | 3.541 | 0,03 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | 500 | 519 | 0,00 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | 10.000 | 7.000 | 0,05 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 1.150 | 865 | 0,01 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | 8.400 | 6.101 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | 5.225 | 3.840 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 5.000 | 3.768 | 0,03 |
| **Starwood Hotels & Resorts Worldwide, Inc.** | | | |
| 7,150 % fällig am 01.12.2019 | 1.400 | 1.612 | 0,01 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | 11.300 | 11.244 | 0,09 |
| **Symantec Corp.** | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2022 | 4.850 | 4.800 | 0,04 |
| **Synchrony Financial** | | | |
| 1,564 % fällig am 03.02.2020 | 15.600 | 15.369 | 0,12 |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | 13.700 | 13.661 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 23.07.2025 | 16.500 | 16.493 | 0,13 |
| **Synovus Financial Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.12.2025 | 12.500 | 12.813 | 0,10 |
| **Teachers Insurance & Annuity Association of America** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2054 | 18.300 | 17.932 | 0,14 |
| **Terraform Global Operating LLC** | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | 1.950 | 1.565 | 0,01 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2020 | € 1.500 | 1.644 | 0,01 |
| 1,850 % fällig am 15.01.2018 | $ 3.000 | 2.992 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2021 | 700 | 743 | 0,01 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | |
| 8,750 % fällig am 14.02.2019 | 4.000 | 4.643 | 0,04 |
| **Time Warner Entertainment Co. LP** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2033 | 400 | 473 | 0,00 |
| **Time Warner, Inc.** | | | |
| 3,600 % fällig am 15.07.2025 | 42.800 | 41.748 | 0,33 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | 10.855 | 13.145 | 0,10 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2026 | 7.000 | 7.084 | 0,06 |
| **Total System Services, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2023 | 500 | 486 | 0,00 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | |
| 2,650 % fällig am 15.08.2019 | 3.000 | 3.004 | 0,02 |
| **UAL 2009-1 Pass-Through Trust** | | | |
| 10,400 % fällig am 01.11.2016 | $ 8.696 | $ 9.230 | 0,07 |
| **UAL 2009-2A Pass-Through Trust** | | | |
| 9,750 % fällig am 15.01.2017 | 27.030 | 28.551 | 0,22 |
| **UDR, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.10.2025 | 6.000 | 6.069 | 0,05 |
| **United Airlines 2014-2 Class A Pass-Through Trust** | | | |
| 3,750 % fällig am 03.09.2026 | 6.100 | 6.161 | 0,05 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | |
| 0,765 % fällig am 17.01.2017 | 29.800 | 29.828 | 0,23 |
| 1,900 % fällig am 16.07.2018 (a) | 7.100 | 7.124 | 0,06 |
| 2,700 % fällig am 15.07.2020 | 2.832 | 2.863 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.07.2025 | 800 | 826 | 0,01 |
| **US Airways 2011-1 Class A Pass-Through Trust** | | | |
| 7,125 % fällig am 22.10.2023 | 4.300 | 4.950 | 0,04 |
| **US Airways 2012-1 Class A Pass-Through Trust** | | | |
| 5,900 % fällig am 01.10.2024 | 7.616 | 8.425 | 0,07 |
| **US Airways 2012-2 Class B Pass-Through Trust** | | | |
| 6,750 % fällig am 03.06.2021 | 10.472 | 11.009 | 0,09 |
| **US Airways 2013-1 Class B Pass-Through Trust** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2021 | 468 | 468 | 0,00 |
| **USAA Capital Corp.** | | | |
| 2,450 % fällig am 01.08.2020 | 3.500 | 3.501 | 0,03 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.10.2020 | 7.300 | 7.081 | 0,06 |
| **Vereit Operating Partnership LP** | | | |
| 3,000 % fällig am 06.02.2019 | 1.900 | 1.833 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2021 | 4.800 | 4.793 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2021 | 100 | 102 | 0,00 |
| 4,672 % fällig am 15.03.2055 | 14.300 | 12.467 | 0,10 |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | 566 | 538 | 0,00 |
| 5,012 % fällig am 21.08.2054 | 2.279 | 2.095 | 0,02 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | 90.960 | 100.155 | 0,78 |
| **Vesey Street Investment Trust I** | | | |
| 4,404 % fällig am 01.09.2016 | 6.500 | 6.628 | 0,05 |
| **Viacom, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 27.02.2042 | 1.000 | 752 | 0,01 |
| 5,850 % fällig am 01.09.2043 | 10.430 | 9.396 | 0,07 |
| **Visa, Inc.** | | | |
| 2,800 % fällig am 14.12.2022 | 1.000 | 1.005 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 14.12.2025 | 4.600 | 4.611 | 0,04 |
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 1,023 % fällig am 26.06.2017 | 35.200 | 34.042 | 0,27 |
| 2,250 % fällig am 23.03.2018 | 1.600 | 1.560 | 0,01 |
| **Wachovia Capital Trust III** | | | |
| 5,570 % fällig am 29.03.2049 | 800 | 772 | 0,01 |
| **Wachovia Corp.** | | | |
| 0,691 % fällig am 15.10.2016 | 1.100 | 1.098 | 0,01 |
| **WEA Finance LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | 16.900 | 16.837 | 0,13 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,550 % fällig am 07.12.2020 | 19.500 | 19.418 | 0,15 |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | 11.000 | 10.979 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | 1.750 | 1.704 | 0,01 |
| 3,152 % fällig am 25.01.2018 | AUD 54.000 | 39.407 | 0,31 |
| 3,300 % fällig am 09.09.2024 | $ 2.900 | 2.888 | 0,02 |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 (a) | 61.890 | 62.523 | 0,49 |
| **Western Gas Partners LP** | | | |
| 3,950 % fällig am 01.06.2025 | 5.800 | 4.877 | 0,04 |
| **Westmoreland Coal Co.** | | | |
| 8,750 % fällig am 01.01.2022 | 8.200 | 5.084 | 0,04 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | |
| 6,950 % fällig am 01.08.2017 | 1.432 | 1.527 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2023 | 7.275 | 8.628 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 01.10.2019 | 2.250 | 2.586 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | 2.000 | 2.386 | 0,02 |
| 7,950 % fällig am 15.03.2025 | 9.300 | 11.542 | 0,09 |
| 8,500 % fällig am 15.01.2025 | 15.942 | 20.491 | 0,16 |
| **Whirlpool Corp.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2016 | 500 | 511 | 0,00 |
| **Whole Foods Market, Inc.** | | | |
| 5,200 % fällig am 03.12.2025 | 6.700 | 6.703 | 0,05 |
| **Willamette Industries, Inc.** | | | |
| 7,350 % fällig am 01.07.2026 | 13.250 | 15.189 | 0,12 |
| 9,000 % fällig am 01.10.2021 | 500 | 635 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Williams Partners LP** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.01.2025 | $ | 801 | $ 603 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 04.03.2024 | | 1.000 | 794 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.11.2023 | | 1.000 | 811 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | | 11.400 | 9.255 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 15.03.2024 | | 122 | 98 | 0,00 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2023 | € | 3.000 | 3.112 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2025 | $ | 8.150 | 7.811 | 0,06 |
| **Wyndham Worldwide Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.03.2022 | | 2.138 | 2.155 | 0,02 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | | 16.460 | 14.145 | 0,11 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2022 | | 26.217 | 24.945 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 71.041 | 63.582 | 0,50 |
| **Yellowstone Energy LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.12.2026 | | 9.175 | 9.155 | 0,07 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | | 3.000 | 2.869 | 0,02 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.04.2020 | | 9.250 | 9.143 | 0,07 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 16.800 | 16.539 | 0,13 |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 1.600 | 1.558 | 0,01 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.02.2023 | | 4.085 | 3.907 | 0,03 |
| 3,450 % fällig am 13.11.2020 | | 4.000 | 4.009 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 13.11.2025 | | 1.600 | 1.625 | 0,01 |
| | | | 4.426.586 | 34,59 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,122 % fällig am 25.04.2035 | | 652 | 646 | 0,01 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,082 % fällig am 25.11.2035 | | 293 | 290 | 0,00 |
| 1,217 % fällig am 25.01.2035 | | 1.913 | 1.776 | 0,01 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2034 | | 1.898 | 1.717 | 0,01 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 20.07.2046 (d) | | 13.626 | 10.001 | 0,08 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2037 | | 128 | 100 | 0,00 |
| 0,732 % fällig am 25.08.2035 (d) | | 2.009 | 1.621 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 (d) | | 1.374 | 1.223 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.03.2036 | | 2.200 | 1.936 | 0,02 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | | 2.900 | 2.834 | 0,02 |
| 0,892 % fällig am 25.01.2036 | | 8.997 | 7.536 | 0,06 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 1,002 % fällig am 25.07.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.06.2034 | | 1.100 | 934 | 0,01 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,492 % fällig am 10.02.2051 | | 93 | 97 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,746 % fällig am 20.09.2034 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **BankUnited Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.09.2045 | | 322 | 283 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,480 % fällig am 25.08.2035 | | 440 | 442 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 25.04.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,652 % fällig am 25.08.2035 | | 254 | 219 | 0,00 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | | 618 | 621 | 0,01 |
| 2,779 % fällig am 25.11.2034 | | 742 | 735 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2034 | | 29 | 29 | 0,00 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2034 | | 245 | 237 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.03.2035 | | 127 | 128 | 0,00 |
| 2,965 % fällig am 25.01.2035 | | 1.268 | 1.246 | 0,01 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust (d)** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.06.2046 | | 8.351 | 6.081 | 0,05 |
| 4,193 % fällig am 25.11.2036 | | 1.092 | 794 | 0,01 |
| **Blackstone CQP Holdco LP** | | | | |
| 2,324 % fällig am 19.03.2019 | | 48.703 | 48.576 | 0,38 |
| **BWAY Mortgage Trust** | | | | |
| 2,809 % fällig am 10.03.2033 | | 1.000 | 997 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 2,606 % fällig am 25.02.2037 | | 92 | 93 | 0,00 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.10.2035 | $ | 331 | $ 307 | 0,00 |
| **Citigroup & Deutsche Bank Mortgage Trust** | | | | |
| 5,617 % fällig am 15.10.2048 | | 138 | 139 | 0,00 |
| 5,886 % fällig am 15.11.2044 | | 74 | 77 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,431 % fällig am 15.10.2049 | | 1.188 | 1.205 | 0,01 |
| 5,710 % fällig am 10.12.2049 | | 91 | 94 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,420 % fällig am 25.09.2035 | | 159 | 160 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.06.2036 | | 19 | 19 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 25.06.2036 | | 2.200 | 1.976 | 0,02 |
| 0,762 % fällig am 25.04.2036 | | 3.600 | 3.411 | 0,03 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2046 | | 1.294 | 1.258 | 0,01 |
| 0,782 % fällig am 25.02.2036 | | 831 | 785 | 0,01 |
| 1,222 % fällig am 25.03.2033 | | 1.663 | 1.546 | 0,01 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | | 913 | 906 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 0,972 % fällig am 25.11.2035 | | 1.650 | 1.616 | 0,01 |
| 1,002 % fällig am 25.04.2035 | | 2.104 | 2.095 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | | 13 | 12 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.02.2036 (d) | | 152 | 143 | 0,00 |
| 2,646 % fällig am 25.11.2034 | | 24 | 23 | 0,00 |
| 4,325 % fällig am 25.01.2036 (d) | | 1.416 | 1.339 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | | 1.041 | 1.078 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 185 | 185 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (d) | | 1.185 | 1.124 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2037 (d) | | 89 | 82 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,162 % fällig am 25.08.2032 | | 143 | 127 | 0,00 |
| 2,265 % fällig am 25.06.2033 | | 29 | 28 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 25.07.2033 | | 27 | 27 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2033 | | 49 | 51 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,844 % fällig am 27.12.2046 | | 765 | 749 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 27.08.2036 | | 319 | 339 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 1,517 % fällig am 25.01.2035 | | 690 | 625 | 0,01 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | | |
| 4,537 % fällig am 10.07.2044 | | 2.800 | 3.025 | 0,02 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.07.2047 | | 1.425 | 1.150 | 0,01 |
| 0,612 % fällig am 25.08.2047 | | 2.080 | 1.675 | 0,01 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | | 66 | 67 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | | 719 | 685 | 0,01 |
| 1,307 % fällig am 25.03.2035 | | 1.700 | 1.579 | 0,01 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.12.2035 | | 1.443 | 1.330 | 0,01 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,089 % fällig am 25.06.2034 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,157 % fällig am 25.09.2035 (d) | | 1.473 | 1.312 | 0,01 |
| **GSC Capital Corporation Mortgage Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 (d) | | 1.724 | 1.343 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,010 % fällig am 25.04.2032 | | 372 | 342 | 0,00 |
| 2,678 % fällig am 25.05.2035 | | 1.838 | 1.717 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,712 % fällig am 19.11.2035 | | 1.957 | 1.642 | 0,01 |
| 2,553 % fällig am 19.04.2034 | | 25 | 25 | 0,00 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 0,912 % fällig am 25.12.2035 | | 1.000 | 963 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.03.2036 | | 492 | 482 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.03.2035 | | 1.649 | 1.427 | 0,01 |
| **HSBC Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,882 % fällig am 20.03.2036 | | 3.100 | 2.946 | 0,02 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 1,122 % fällig am 25.03.2035 | | 635 | 580 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.07.2035 | | 1.482 | 1.285 | 0,01 |
| 2,668 % fällig am 25.03.2036 | | 2.272 | 1.775 | 0,01 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 1,352 % fällig am 25.09.2035 | $ | 531 | $ 502 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,799 % fällig am 26.05.2037 | | 734 | 660 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,616 % fällig am 15.11.2043 | | 700 | 716 | 0,01 |
| 5,440 % fällig am 12.06.2047 | | 1.479 | 1.515 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 2.000 | 1.788 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,747 % fällig am 26.09.2036 | | 2.839 | 2.531 | 0,02 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,866 % fällig am 15.09.2045 | | 5.229 | 5.494 | 0,04 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 (d) | | 3.851 | 3.057 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,222 % fällig am 25.10.2035 | | 2.403 | 2.256 | 0,02 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,127 % fällig am 25.08.2035 | | 1.935 | 1.922 | 0,02 |
| 1,322 % fällig am 25.06.2035 | | 1.800 | 1.677 | 0,01 |
| 1,352 % fällig am 25.04.2035 | | 1.500 | 1.467 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,772 % fällig am 21.11.2034 | | 49 | 50 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loans Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.02.2034 | | 49 | 50 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 | | 1.113 | 1.018 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.11.2035 | | 6 | 5 | 0,00 |
| 0,802 % fällig am 25.08.2035 | | 2.255 | 2.061 | 0,02 |
| 1,082 % fällig am 25.06.2028 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,244 % fällig am 25.10.2035 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 1,313 % fällig am 25.01.2029 | | 661 | 625 | 0,01 |
| 1,904 % fällig am 25.10.2035 | | 309 | 301 | 0,00 |
| 2,935 % fällig am 25.05.2033 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 5,463 % fällig am 25.05.2036 | | 1.918 | 1.788 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (d) | | 155 | 145 | 0,00 |
| **Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,172 % fällig am 12.12.2049 | | 1.468 | 1.493 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 12.09.2049 | | 97 | 101 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 1,412 % fällig am 25.06.2035 | | 2.100 | 1.897 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,439 % fällig am 12.02.2044 | | 195 | 195 | 0,00 |
| 5,569 % fällig am 15.12.2044 | | 13.423 | 13.984 | 0,11 |
| 5,610 % fällig am 15.04.2049 | | 1.021 | 1.021 | 0,01 |
| 5,809 % fällig am 12.12.2049 | | 4.250 | 4.444 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | | 8.000 | 6.794 | 0,05 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,794 % fällig am 15.08.2045 | | 854 | 878 | 0,01 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.10.2035 | | 321 | 322 | 0,00 |
| 0,912 % fällig am 25.07.2035 | | 608 | 592 | 0,01 |
| 0,932 % fällig am 25.09.2035 | | 3.600 | 3.274 | 0,03 |
| 1,097 % fällig am 25.03.2035 | | 125 | 117 | 0,00 |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | | 1.481 | 1.296 | 0,01 |
| 1,352 % fällig am 25.11.2034 | | 376 | 335 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.02.2035 (d) | | 597 | 504 | 0,00 |
| **OBP Depositor LLC Trust** | | | | |
| 4,646 % fällig am 15.07.2045 | | 3.100 | 3.347 | 0,03 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corporation Trust** | | | | |
| 0,832 % fällig am 25.11.2035 | | 7.100 | 6.960 | 0,05 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.02.2036 | | 2.300 | 1.934 | 0,02 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,757 % fällig am 25.08.2035 | | 637 | 544 | 0,00 |
| 3,116 % fällig am 25.03.2035 (d) | | 473 | 413 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 (d) | | 6.945 | 6.106 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (d) | | 9.006 | 7.010 | 0,06 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 371 | 366 | 0,00 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | | 2.074 | 2.055 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 0,862 % fällig am 25.11.2035 | $ 6.400 | $ 5.623 | 0,04 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2035 | 1.068 | 1.054 | 0,01 |
| 1,292 % fällig am 25.05.2035 | 1.723 | 1.679 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 0,872 % fällig am 25.04.2035 | 3.501 | 3.454 | 0,03 |
| 0,902 % fällig am 25.02.2035 | 1.337 | 1.322 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 (d) | 2.724 | 1.712 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 0,712 % fällig am 25.12.2035 | 1.603 | 1.416 | 0,01 |
| 1,097 % fällig am 25.01.2035 | 861 | 796 | 0,01 |
| 1,127 % fällig am 25.04.2035 | 33 | 32 | 0,00 |
| 1,397 % fällig am 25.03.2035 | 1.234 | 1.178 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 20.05.2035 | 792 | 730 | 0,01 |
| 1,038 % fällig am 20.05.2034 | 2.109 | 2.035 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.06.2036 | 2.296 | 2.134 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,605 % fällig am 25.04.2035 | 790 | 748 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 1,112 % fällig am 25.06.2035 | 3.200 | 3.144 | 0,02 |
| 1,142 % fällig am 25.02.2035 | 1.900 | 1.804 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.07.2046 (d) | 513 | 407 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2036 | 614 | 440 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | 34 | 26 | 0,00 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | 7 | 6 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2036 (d) | 68 | 53 | 0,00 |
| 1,717 % fällig am 25.03.2046 | 692 | 579 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 0,912 % fällig am 25.02.2035 | 2.000 | 1.900 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2036 | 35 | 35 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2036 | 1.328 | 1.283 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,401 % fällig am 25.07.2033 | 1.056 | 1.058 | 0,01 |
| 2,488 % fällig am 25.06.2033 | 29 | 28 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2034 | 951 | 971 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2034 | 606 | 606 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 6,071 % fällig am 25.09.2037 | 198 | 206 | 0,00 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,082 % fällig am 25.10.2035 | 4.398 | 4.182 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.12.2045 | 22 | 22 | 0,00 |
| 1,257 % fällig am 25.08.2046 | 30 | 25 | 0,00 |
| 1,578 % fällig am 25.11.2041 | 441 | 413 | 0,00 |
| 2,443 % fällig am 25.03.2035 | 365 | 365 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,439 % fällig am 25.05.2041 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 25.06.2037 | 10.006 | 8.060 | 0,06 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,477 % fällig am 25.06.2033 | 482 | 480 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust (d)** | | | |
| 0,962 % fällig am 25.03.2037 | 6.414 | 4.693 | 0,04 |
| 2,768 % fällig am 25.07.2037 | 823 | 702 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 0,882 % fällig am 25.11.2035 | 1.400 | 1.353 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,680 % fällig am 25.12.2033 | 41 | 40 | 0,00 |
| 2,752 % fällig am 25.08.2036 (d) | 3.032 | 2.877 | 0,02 |
| 2,853 % fällig am 25.12.2034 | 23 | 23 | 0,00 |
| | | 293.435 | 2,29 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | 15.100 | 15.972 | 0,13 |
| **Franklin, Ohio, Tobacco Settlement Financing Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2047 | $ 9.260 | $ 8.015 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2047 | 900 | 835 | 0,01 |
| **Los Angeles, California, Metropolitan Water District of Southern California Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 5,906 % fällig am 01.07.2025 | 3.700 | 4.165 | 0,03 |
| **Mercer, New Jersey, Tobacco Settlement Financing Corporation Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.06.2041 | 7.720 | 6.414 | 0,05 |
| **New York, New York, Metropolitan Transportation Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,814 % fällig am 15.11.2040 | 12.500 | 16.571 | 0,13 |
| **New York, New York, Transitional Finance Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 5,267 % fällig am 01.05.2027 | 2.200 | 2.489 | 0,02 |
| **Riverside, California, Sewer Revenue Bonds, Series 2009** | | | |
| 7,000 % fällig am 01.08.2029 | 1.400 | 1.610 | 0,01 |
| **Sacramento, California, General Obligation Bonds, Series 2009** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2034 | 1.800 | 2.513 | 0,02 |
| **Sacramento, Golden State, California, Tobacco Securitization Corporation Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.06.2047 | 15.500 | 14.560 | 0,11 |
| | | 73.144 | 0,57 |
| | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Citigroup Capital XIII** | | | |
| 6,692 % fällig am 30.10.2040 | 21.000 | 546 | 0,01 |
| **Farm Credit Bank of Texas** | | | |
| 10,000 % fällig am 31.12.2049 | 4.000 | 4.939 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 2,221 % fällig am 16.01.2018 (c) | 3.600 | 83 | 0,00 |
| | | 5.568 | 0,05 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | $ 14 | 13 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2042 - 25.09.2042 | 79 | 78 | 0,00 |
| 1,322 % fällig am 25.04.2032 | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 01.06.2043 - 01.10.2044 | 66 | 67 | 0,00 |
| 2,226 % fällig am 01.12.2034 | 139 | 144 | 0,00 |
| 2,319 % fällig am 01.03.2037 | 116 | 123 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.09.2043 | 143.488 | 143.838 | 1,13 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041 | 1.271 | 1.358 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 | 16 | 17 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2036 | 1.514 | 1.648 | 0,01 |
| 5,808 % fällig am 01.01.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,823 % fällig am 01.02.2037 | 1 | 2 | 0,00 |
| 5,828 % fällig am 01.12.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,888 % fällig am 01.01.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,904 % fällig am 01.03.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,975 % fällig am 01.04.2037 | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,022 % fällig am 01.09.2037 | 3 | 4 | 0,00 |
| 6,141 % fällig am 01.10.2036 | 7 | 7 | 0,00 |
| 6,262 % fällig am 01.09.2037 | 5 | 5 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2030 | 18.325 | 25.991 | 0,21 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.02.2046 | 3.800 | 3.793 | 0,03 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 2,773 % fällig am 01.10.2038 | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2040 | 191 | 206 | 0,00 |
| 5,646 % fällig am 01.03.2036 | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,727 % fällig am 01.03.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,941 % fällig am 01.03.2037 | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,961 % fällig am 01.01.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,992 % fällig am 25.11.2055 | 6.879 | 4.022 | 0,03 |
| 6,168 % fällig am 01.06.2037 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | 3.000 | 3.180 | 0,03 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,720 % fällig am 01.02.2024 | $ 208 | $ 219 | 0,00 |
| 5,240 % fällig am 01.08.2023 | 186 | 202 | 0,00 |
| | | 184.951 | 1,45 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a) | 57.167 | 55.391 | 0,43 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (e) | 42.540 | 47.318 | 0,37 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 | 47.882 | 49.082 | 0,38 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (a)(e)(f) | 32.015 | 37.985 | 0,30 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 (a) | 416.465 | 411.080 | 3,21 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 (a) | 66.950 | 60.088 | 0,47 |
| 2,750 % fällig am 15.08.2042 (e) | 1.175 | 1.123 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 (a) | 230.030 | 223.461 | 1,75 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042 - 15.05.2045 (a)(e) | 273.125 | 272.133 | 2,13 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2042 - 15.08.2044 (a)(e)(f) | 224.260 | 229.714 | 1,80 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2040 (e)(f) | 5.625 | 7.080 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 (e) | 1.950 | 2.541 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 15.11.2027 (e)(f) | 3.100 | 4.293 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2030 | 5.645 | 8.188 | 0,06 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 0,625 % fällig am 31.07.2017 (e)(f) | 10.000 | 9.945 | 0,08 |
| 1,375 % fällig am 31.08.2020 - 30.09.2020 (a)(e)(f) | 1.775.460 | 1.746.829 | 13,65 |
| 1,500 % fällig am 31.05.2020 (e) | 6.950 | 6.891 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 (a) | 964.825 | 940.855 | 7,35 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 (a) | 261.855 | 261.297 | 2,04 |
| **US Treasury Strip Principal** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.08.2043 - 15.11.2043 | 44.300 | 18.984 | 0,15 |
| | | 4.394.278 | 34,34 |
| Summe USA | | 10.167.982 | 79,46 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (b)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 65.043.920 | 650.569 | 5,08 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 15.741.031** | **123,01** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 1.117 | $ 983 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 6.664 | (3.972) | (0,03) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 7.875 | (5.450) | (0,04) |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 291 | 177 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 8.099 | (3.442) | (0,03) |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 2.739 | (1.721) | (0,01) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 198 | (60) | 0,00 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.661 | (509) | (0,01) |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 677 | 433 | 0,00 |
| | | | | $ (13.561) | (0,11) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (13.561)** | **(0,11)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | $ 12.000 | $ (95) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 80.685 | $ (2.591) | (0,02) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 75.890 | (307) | 0,00 |
| CDX.IG-22 Index | 1,000 % | 20.06.2019 | 4.975 | (36) | 0,00 |
| CDX.IG-23 Index | 1,000 % | 20.12.2019 | 101.000 | (820) | (0,01) |
| CDX.IG-24 Index | 1,000 % | 20.06.2020 | 539.590 | (3.226) | (0,02) |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 1.151.600 | (2.347) | (0,02) |
| | | | | $ (9.327) | (0,07) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month Canadian Bank Bill | 2,500 % | 19.06.2025 | CAD 1.000 | $ (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,300 % | 06.05.2017 | $ 275.100 | (609) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2019 | 1.009.900 | (8.684) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,910 % | 20.08.2019 | 1.075.700 | (8.658) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 23.050 | (413) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 400 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 % | 19.08.2025 | 105.800 | (2.181) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,335 % | 24.08.2025 | 78.400 | (1.623) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 1.313.600 | 4.445 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 138.800 | (3.925) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,350 % | 10.09.2017 | € 461.200 | (3.778) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 3.400 | 649 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 3,000 % | 11.09.2024 | £ 11.200 | (609) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 25.000 | (238) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,150 % | 16.03.2046 | 8.050 | (52) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,175 % | 16.03.2046 | 10.250 | (42) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 36.900 | (725) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 % | 17.09.2021 | JPY 3.480.000 | (319) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 18.09.2023 | 11.390.000 | (6.146) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 20.09.2024 | 1.830.000 | (401) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,610 % | 07.07.2021 | MXN 1.285.400 | (590) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,630 % | 07.07.2021 | 25.000 | (24) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,750 % | 31.08.2021 | 883.500 | (1.805) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,840 % | 14.09.2021 | 301.800 | 19 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,810 % | 29.09.2021 | 335.000 | (818) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,160 % | 03.01.2035 | 39.500 | (144) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,190 % | 03.01.2035 | 488.300 | (3.051) | (0,02) |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | NZD 217.600 | 3.109 | 0,02 |
| | | | | | $ (36.620) | (0,29) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (46.041)** | **(0,36)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 6,700 | 29.09.2016 | $ 33.250 | $ 749 | $ 946 | 0,01 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,933 % | 13.08.2018 | $ 33.800 | $ 3.515 | $ 3.016 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,950 % | 17.08.2017 | 40.000 | 2.656 | 486 | 0,01 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,000 % | 07.12.2016 | 245.600 | 392 | 227 | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,000 % | 08.12.2016 | 422.700 | 705 | 390 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,020 % | 18.12.2017 | 55.000 | 4.442 | 3.663 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 11.710 | $ 7.782 | 0,06 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 76.500 | $ (137) | $ (64) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 95.100 | (174) | (153) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BPS | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 63.000 | (110) | (53) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 135.800 | (254) | (113) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 110.000 | (188) | (177) | (0,01) |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 35.000 | (77) | (29) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | JPM | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 83.200 | (48) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 83.200 | (166) | (127) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,000 % | 20.01.2016 | 83.500 | (163) | (40) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 16.000 | (64) | (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,050 % | 17.02.2016 | 66.000 | (97) | (79) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.478) | $ (838) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 7,000 | 29.09.2016 | $ 33.250 | $ (518) | $ (489) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 7,000 | 07.12.2016 | 108.860 | (1.532) | (2.019) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,000 | 07.12.2016 | 75.640 | (1.061) | (1.403) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | GLM | 7,050 | 08.12.2016 | 52.340 | (730) | (891) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,050 | 08.12.2016 | 139.570 | (1.970) | (2.376) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | 7,150 | 20.12.2016 | 13.000 | (188) | (193) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | 6,280 | 29.09.2016 | 33.250 | (199) | (69) | 0,00 |
| | | | | | $ (6.198) | $ (7.440) | (0,06) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 28.03.2016 | $ 148.100 | $ (633) | $ (146) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,900 % | 13.08.2018 | 148.700 | (3.515) | (2.365) | (0,02) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,870 % | 17.08.2017 | 160.000 | (2.656) | (282) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,670 % | 07.12.2016 | 53.400 | (391) | (329) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,630 % | 08.12.2016 | 91.900 | (708) | (519) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 % | 18.12.2017 | 225.000 | (4.226) | (2.732) | (0,02) |
| | | | | | | | $ (12.129) | $ (6.373) | (0,05) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 215,949 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 12.03.2020 | $ 36.100 | $ (310) | $ (18) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | 217,965 | Maximal [1-(Final Index/Initial Index), 0] | 29.09.2020 | 29.200 | (377) | (19) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | DUB | 218,011 | Maximal [-(Final Index/Initial Index -1), 0] | 13.10.2020 | 23.600 | (231) | (16) | 0,00 |
| | | | | | | $ (918) | $ (53) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Dow Chemical Co. | (1,000 %) | 20.12.2020 | GST | $ 6.000 | $ (65) | $ (66) | $ 1 | 0,00 |
| Freeport-McMoRan Corp. | (3,990 %) | 20.12.2018 | BOA | 1.000 | (23) | (1) | (22) | 0,00 |
| Rohm & Haas Co. | (1,000 %) | 20.09.2017 | BOA | 1.500 | (23) | (16) | (7) | 0,00 |
| | | | | | $ (111) | $ (83) | $ (28) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Aegon NV | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | € 3.000 | $ 39 | $ 31 | $ 8 | 0,00 |
| Aegon NV | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 15.000 | 194 | 154 | 40 | 0,00 |
| American Tower Corp. | 1,000 % | 20.06.2020 | MYC | $ 3.200 | (85) | (112) | 27 | 0,00 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2017 | BPS | 400 | (2) | (15) | 13 | 0,00 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2017 | CBK | 15.000 | (55) | (698) | 643 | 0,00 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2017 | DUB | 10.000 | (37) | (475) | 438 | 0,00 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2017 | FBF | 10.000 | (37) | (524) | 487 | 0,00 |
| Anheuser-Busch InBev S.A. | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 1.500 | 22 | 37 | (15) | 0,00 |
| Apache Corp. | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 4.900 | (236) | (205) | (31) | 0,00 |
| Apache Corp. | 1,000 % | 20.06.2020 | CBK | 1.000 | (41) | (20) | (21) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.06.2016 | BPS | 50.000 | 222 | 841 | (619) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 16.800 | 295 | 318 | (23) | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | € 1.250 | 20 | (17) | 37 | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 650 | 10 | (8) | 18 | 0,00 |
| BMW Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 5.950 | 94 | (91) | 185 | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | $ 5.000 | 11 | 20 | (9) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 5.000 | 11 | 22 | (11) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 300 | 1 | 1 | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 13.100 | (1.134) | (686) | (448) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 4.780 | (697) | (293) | (404) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BRC | 700 | (102) | (44) | (58) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 20.000 | (1.731) | (1.060) | (671) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | FBF | 900 | (131) | (56) | (75) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 9.200 | (797) | (436) | (361) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 2.200 | (321) | (140) | (181) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | HUS | 950 | (129) | (73) | (56) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | HUS | 5.100 | (743) | (338) | (405) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2017 | JPM | 3.000 | (136) | (141) | 5 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 2.150 | (207) | (67) | (140) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | MYC | 42.400 | (3.671) | (1.952) | (1.719) | (0,03) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 23.500 | (2.267) | (843) | (1.424) | (0,02) |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 4.000 | 5 | 51 | (46) | 0,00 |
| Caterpillar, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 12.200 | 28 | 169 | (141) | 0,00 |
| Caterpillar, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | BPS | 3.300 | 8 | 46 | (38) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2016 | BPS | 20.000 | (3.167) | 671 | (3.838) | (0,02) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2016 | BRC | 2.000 | (317) | 67 | (384) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.06.2020 | GST | 6.800 | (4.725) | 277 | (5.002) | (0,04) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.06.2020 | JPM | 7.100 | (4.934) | 276 | (5.210) | (0,04) |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 8.800 | (16) | (20) | 4 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 4.600 | (19) | (87) | 68 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 20.900 | (39) | (69) | 30 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | DUB | 8.100 | (15) | 24 | (39) | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 22.850 | (42) | 30 | (72) | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 9.900 | (18) | (88) | 70 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 10.400 | (19) | (6) | (13) | 0,00 |
| Continental Resources, Inc. | 1,000 % | 20.06.2016 | GST | 4.000 | (41) | 51 | (92) | 0,00 |
| Danone S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 6.100 | 15 | 99 | (84) | 0,00 |
| Devon Energy Corp. | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 1.800 | (236) | (273) | 37 | 0,00 |
| Devon Energy Corp. | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 1.900 | (249) | (275) | 26 | 0,00 |
| Domtar Corp. | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 2.750 | 23 | (63) | 86 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 % | 20.12.2019 | JPM | 600 | (62) | 3 | (65) | 0,00 |
| Exelon Corp. | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | 15.000 | 74 | (14) | 88 | 0,00 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2017 | BOA | 15.000 | (1.983) | (603) | (1.380) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 2.200 | (789) | (345) | (444) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2017 | MYC | 15.000 | (1.983) | (562) | (1.421) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 2.750 | (987) | (413) | (574) | (0,01) |
| General Electric Capital Corp. | 5,000 % | 20.06.2018 | BRC | 2.700 | 319 | 209 | 110 | 0,00 |
| Gilead Sciences, Inc. | 1,000 % | 20.06.2017 | GST | 5.000 | 60 | (20) | 80 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 17.350 | 173 | 129 | 44 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 3.000 | 26 | (3) | 29 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 4.000 | 35 | (4) | 39 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.06.2020 | FBF | 31.550 | 315 | 198 | 117 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 700 | 6 | 2 | 4 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 6.100 | 46 | 25 | 21 | 0,00 |
| HOCHTIEF AG | 5,000 % | 20.06.2019 | GST | € 2.600 | 431 | 402 | 29 | 0,00 |
| Host Hotels & Resorts LP | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | $ 3.300 | (90) | (95) | 5 | 0,00 |
| Joint Stock Company Russian Railways | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 18.000 | (52) | (392) | 340 | 0,00 |
| Marathon Oil Corp. | 1,000 % | 20.06.2018 | BOA | 4.500 | (168) | (15) | (153) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.09.2021 | DUB | 7.200 | (3) | 69 | (72) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | $ 28.925 | $ 228 | $ 293 | $ (65) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 14.800 | 93 | 58 | 35 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 52.500 | (431) | (198) | (233) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 400 | (11) | (6) | (5) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 6.000 | (49) | 21 | (70) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 13.900 | (390) | (232) | (158) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 1.600 | (9) | 5 | (14) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 8.300 | (233) | (147) | (86) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 61.550 | (332) | (62) | (270) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 8.600 | (241) | (156) | (85) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 27.200 | (147) | (51) | (96) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 5.800 | (48) | (15) | (33) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 300 | (3) | (2) | (1) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 25.000 | (205) | (122) | (83) | 0,00 |
| Morgan Stanley | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 19.400 | 192 | 159 | 33 | 0,00 |
| Navient Corp. | 5,000 % | 20.06.2020 | CBK | 300 | (15) | 26 | (41) | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.09.2016 | CBK | 8.000 | 55 | (77) | 132 | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.06.2021 | DUB | 2.000 | 32 | (88) | 120 | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.09.2016 | FBF | 20.000 | 139 | (202) | 341 | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 22.500 | 156 | (227) | 383 | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 25.000 | 173 | (193) | 366 | 0,00 |
| Pacific Gas & Electric Co. | 1,000 % | 20.09.2016 | RYL | 2.500 | 17 | (27) | 44 | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2018 | BPS | 17.000 | (3.186) | (825) | (2.361) | (0,02) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BPS | 1.000 | (248) | (70) | (178) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.09.2019 | BPS | 6.000 | (1.573) | (340) | (1.233) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2018 | BRC | 47.000 | (8.808) | (2.085) | (6.723) | (0,07) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 25.400 | (2.293) | (1.271) | (1.022) | (0,02) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | DUB | 17.800 | (1.607) | (958) | (649) | (0,01) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 14.500 | (1.310) | (708) | (602) | (0,01) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 23.500 | (2.122) | (1.179) | (943) | (0,02) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 24.500 | (2.212) | (1.279) | (933) | (0,02) |
| Plains All American Pipeline LP | 1,000 % | 20.09.2017 | DUB | 3.000 | (26) | (88) | 62 | 0,00 |
| Plains All American Pipeline LP | 1,000 % | 20.09.2017 | FBF | 20.500 | (181) | (586) | 405 | 0,00 |
| Plains All American Pipeline LP | 1,000 % | 20.12.2017 | FBF | 1.300 | (15) | 1 | (16) | 0,00 |
| Plains All American Pipeline LP | 1,000 % | 20.12.2017 | GST | 2.100 | (25) | 7 | (32) | 0,00 |
| Prologis LP | 1,000 % | 20.03.2016 | UAG | 3.900 | 9 | (101) | 110 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 36.400 | 312 | 466 | (154) | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 5.800 | 90 | 31 | 59 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | BOA | 25.000 | 261 | 36 | 225 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 14.000 | 116 | (20) | 136 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | CBK | 18.500 | 193 | (10) | 203 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 271.400 | 2.933 | (930) | 3.863 | 0,02 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | DUB | 23.300 | 243 | (100) | 343 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 94.200 | 1.018 | 260 | 758 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | GST | 33.500 | 349 | (224) | 573 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2020 | JPM | 62.100 | 513 | (110) | 623 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2019 | MYC | 88.650 | 958 | (571) | 1.529 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 100.000 | 1.042 | (48) | 1.090 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.06.2020 | MYC | 18.500 | 153 | (32) | 185 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 25.800 | (2.367) | (2.832) | 465 | (0,02) |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.06.2016 | DUB | 4.000 | 16 | 80 | (64) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 13.400 | 27 | 276 | (249) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.06.2016 | HUS | 2.900 | 11 | 55 | (44) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.06.2016 | MYC | 32.000 | 126 | 600 | (474) | 0,00 |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.06.2020 | BOA | 8.400 | (1.443) | 402 | (1.845) | (0,01) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.03.2020 | BRC | 3.200 | (513) | 40 | (553) | 0,00 |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.09.2020 | BRC | 22.300 | (4.067) | 64 | (4.131) | (0,03) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.09.2020 | FBF | 5.000 | (912) | 0 | (912) | (0,01) |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 5.800 | (1.058) | 26 | (1.084) | (0,01) |
| State of Connecticut | 1,600 % | 20.03.2021 | GST | 5.000 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| State of New York | 1,850 % | 20.03.2021 | BOA | 1.800 | 126 | 0 | 126 | 0,00 |
| Statoil ASA | 1,000 % | 20.06.2016 | BRC | 13.200 | 56 | 257 | (201) | 0,00 |
| Statoil ASA | 1,000 % | 20.06.2016 | FBF | 5.000 | 21 | 97 | (76) | 0,00 |
| Statoil ASA | 1,000 % | 20.06.2016 | SOG | 13.200 | 56 | 251 | (195) | 0,00 |
| Statoil ASA | 1,000 % | 20.06.2016 | UAG | 9.900 | 42 | 198 | (156) | 0,00 |
| Teck Resources Ltd. | 1,000 % | 20.03.2021 | MYC | 10.000 | (4.952) | (521) | (4.431) | (0,04) |
| Toyota Motor Credit Corp. | 1,000 % | 20.06.2016 | CBK | 4.000 | 18 | (10) | 28 | 0,00 |
| Toyota Motor Credit Corp. | 1,000 % | 20.06.2016 | FBF | 5.200 | 24 | (22) | 46 | 0,00 |
| Toyota Motor Credit Corp. | 1,000 % | 20.06.2016 | HUS | 9.700 | 45 | (59) | 104 | 0,00 |
| United Kingdom Gilt | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 28.500 | 70 | 364 | (294) | 0,00 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | 5,000 % | 20.12.2020 | CBK | 4.500 | (47) | 115 | (162) | 0,00 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | 5,000 % | 20.06.2016 | GST | 9.000 | 168 | (142) | 310 | 0,00 |
| Viacom, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 2.800 | (76) | (76) | 0 | 0,00 |
| Viacom, Inc. | 1,000 % | 20.03.2021 | GST | 10.100 | (382) | (395) | 13 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 33.000 | (47) | (184) | 137 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.06.2016 | BPS | 1.900 | 2 | (6) | 8 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.03.2017 | BRC | 26.100 | (69) | 280 | (349) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.03.2017 | FBF | 17.800 | (47) | 194 | (241) | 0,00 |
| Wesfarmers Ltd. | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | $ 5.000 | 58 | 113 | (55) | 0,00 |
| Whirlpool Corp. | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 20.900 | 285 | 69 | 216 | 0,00 |
| | | | | | $ (61.225) | $ (20.163) | $ (41.062) | (0,48) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | FBF | $ 89.400 | $ (4.312) | $ (4.803) | $ 491 | (0,03) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | GST | 21.600 | (1.042) | (1.177) | 135 | (0,01) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | MEI | 24.600 | (1.186) | (1.378) | 192 | (0,01) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | MYC | 15.300 | (738) | (886) | 148 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 19 Index | 1,000 % | 20.06.2018 | BOA | JPY 2.220.000 | 314 | 70 | 244 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 19 Index | 1,000 % | 20.06.2018 | DUB | 947.000 | 134 | 111 | 23 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 19 Index | 1,000 % | 20.06.2018 | GST | 3.600.000 | 510 | 406 | 104 | 0,01 |
| iTraxx Japan Series 20 Index | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 810.000 | 127 | 83 | 44 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 20 Index | 1,000 % | 20.12.2018 | BRC | 2.260.000 | 354 | 96 | 258 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 20 Index | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 1.610.000 | 252 | 155 | 97 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 5.657.000 | 597 | 692 | (95) | 0,01 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 4.675.000 | 493 | 465 | 28 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | DUB | 2.979.000 | 314 | 228 | 86 | 0,00 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 10.234.000 | 1.080 | 1.144 | (64) | 0,01 |
| iTraxx Japan Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 11.248.000 | 1.187 | 1.369 | (182) | 0,01 |
| | | | | | $ (1.916) | $ (3.425) | $ 1.509 | (0,01) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssat | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | DUB | BRL 442.100 | $ 487 | $ 71 | $ 416 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,720 % | 02.01.2018 | DUB | 32.600 | (187) | (67) | (120) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,720 % | 02.01.2018 | GLM | 282.800 | (1.625) | (36) | (1.589) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | GLM | 76.000 | (205) | 7 | (212) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | HUS | 19.700 | (53) | (28) | (25) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | HUS | 50.000 | 241 | 30 | 211 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.08.2020 | CBK | € 50.000 | 306 | 0 | 306 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,720 % | 15.08.2020 | DBL | 59.300 | 231 | 5 | 226 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,770 % | 15.08.2020 | BOA | 23.400 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,770 % | 15.08.2020 | CBK | 25.200 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,995 % | 08.12.2020 | BPS | 10.000 | (60) | 0 | (60) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 1,005 % | 15.12.2020 | GLM | 22.200 | (147) | 0 | (147) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,650 % | 02.06.2021 | GLM | MXN 36.900 | 106 | 49 | 57 | 0,00 |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | CBK | NZD 22.000 | 1.544 | 371 | 1.173 | 0,01 |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | DUB | 65.800 | 4.619 | 1.173 | 3.446 | 0,04 |
| Zahlung | New Zealand Bank Bill 3-Month FRA | 5,000 % | 17.12.2024 | JPM | 17.600 | 1.236 | 311 | 925 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,533 % | 07.11.2016 | MYC | $ 30.300 | (599) | 1 | (600) | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,540 % | 07.11.2016 | DUB | 7.500 | (150) | 0 | (150) | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,273 % | 30.09.2020 | BOA | 39.750 | 452 | 0 | 452 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,303 % | 30.09.2020 | BOA | 77.150 | 763 | 0 | 763 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,278 % | 01.10.2020 | BOA | 39.500 | 440 | 0 | 440 | 0,00 |
| | | | | | | $ 7.453 | $ 1.887 | $ 5.566 | 0,06 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 104.265 | AUD | 143.471 | CBK | $ 117 | $ 0 | $ 117 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 143.471 | $ | 103.586 | GLM | 0 | (796) | (796) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 757.672 | | 200.564 | BPS | 9.052 | 0 | 9.052 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 194.036 | BRL | 757.672 | BPS | 0 | (2.523) | (2.523) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 931.816 | $ | 238.634 | DUB | 3.103 | 0 | 3.103 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 237.799 | BRL | 931.816 | DUB | 0 | (2.269) | (2.269) | (0,02) |
| 01/2016 | | 44.597 | | 174.144 | JPM | 0 | (580) | (580) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 174.144 | $ | 49.734 | JPM | 5.717 | 0 | 5.717 | 0,05 |

| Abrechnungsmonat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 64.262 | CAD | 85.459 | HUS | $ 0 | $ (2.741) | $ (2.741) | (0,02) |
| 01/2016 | | 126.268 | | 168.900 | HUS | 0 | (4.678) | (4.678) | (0,04) |
| 01/2016 | CAD | 161.761 | $ | 121.519 | MSB | 5.069 | 0 | 5.069 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 118.931 | CAD | 161.761 | SCX | 0 | (2.480) | (2.480) | (0,02) |
| 01/2016 | | 3.756 | | 5.100 | SOG | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.066 | CHF | 3.139 | CBK | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 284 | $ | 286 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 26.540 | CNY | 171.103 | BOA | 0 | (400) | (400) | 0,00 |
| 01/2016 | | 57.945 | | 374.904 | BPS | 0 | (669) | (669) | 0,00 |
| 01/2016 | | 26.540 | | 171.050 | BRC | 0 | (408) | (408) | 0,00 |
| 01/2016 | | 93 | € | 85 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 217 | $ | 238 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 135 | € | 125 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.832 | | 1.711 | BPS | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 2.817 | $ | 3.075 | CBK | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 45.210 | € | 41.641 | CBK | 26 | (2) | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 332.037 | $ | 355.346 | CBK | 259 | (5.605) | (5.346) | (0,04) |
| 01/2016 | | 747.993 | | 793.012 | GLM | 103 | (19.636) | (19.533) | (0,15) |
| 01/2016 | $ | 4.886 | € | 4.597 | GLM | 108 | 0 | 108 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.124.455 | | 1.023.214 | HUS | 0 | (12.938) | (12.938) | (0,10) |
| 01/2016 | | 13.765 | | 12.708 | JPM | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 01/2016 | | 485 | | 445 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 60 | | 55 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 4 | $ | 4 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.935 | | 12.638 | SOG | 0 | (327) | (327) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.077 | € | 8.428 | UAG | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 123 | $ | 182 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.148 | £ | 2.743 | BOA | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 281 | $ | 419 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 289 | | 426 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.831 | | 11.970 | BPS | 428 | 0 | 428 | 0,00 |
| 01/2016 | | 609 | | 903 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 286.232 | | 432.436 | CBK | 10.559 | 0 | 10.559 | 0,08 |
| 01/2016 | | 8.495 | | 12.810 | JPM | 289 | 0 | 289 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.417 | £ | 942 | JPM | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 89 | $ | 132 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.002 | £ | 677 | RBC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 442.221 | | 298.803 | SCX | 0 | (1.815) | (1.815) | (0,01) |
| 01/2016 | | 63.577 | INR | 4.222.290 | CBK | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 4.209.489 | $ | 63.345 | UAG | 0 | (111) | (111) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 18.022.246 | | 147.542 | GLM | 0 | (2.275) | (2.275) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 91.575 | JPY | 11.173.800 | GLM | 1.312 | 0 | 1.312 | 0,01 |
| 01/2016 | | 35.585 | | 4.360.300 | JPM | 662 | 0 | 662 | 0,01 |
| 01/2016 | | 20.564 | | 2.488.146 | MSB | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 90.258.107 | $ | 77.621 | FBF | 856 | 0 | 856 | 0,01 |
| 01/2016 | MYR | 230.816 | | 52.668 | GLM | 0 | (839) | (839) | (0,01) |
| 01/2016 | | 90.615 | | 20.693 | HUS | 0 | (313) | (313) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.052 | NZD | 13.884 | BOA | 452 | 0 | 452 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 143.471 | $ | 104.124 | CBK | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.320 | | 5.844 | JPM | 0 | (198) | (198) | 0,00 |
| 02/2016 | | 136.282 | | 97.374 | MSB | 0 | (1.593) | (1.593) | (0,01) |
| 02/2016 | BRL | 931.816 | | 235.480 | DUB | 2.341 | 0 | 2.341 | 0,02 |
| 02/2016 | CAD | 174.176 | | 130.723 | JPM | 5.324 | 0 | 5.324 | 0,04 |
| 02/2016 | | 83.891 | | 60.547 | SCX | 151 | 0 | 151 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.496 | | 2.602 | SCX | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 145 | | 148 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.301 | | 7.313 | DUB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 7.349 | € | 6.760 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 597 | | 561 | FBF | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.023.214 | $ | 1.125.252 | HUS | 12.947 | 0 | 12.947 | 0,10 |
| 02/2016 | | 12.876 | | 14.094 | MSB | 94 | 0 | 94 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.424 | £ | 954 | CBK | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.648 | | 1.107 | JPM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 298.803 | $ | 442.255 | SCX | 1.815 | 0 | 1.815 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 2.488.146 | | 20.575 | MSB | 0 | (122) | (122) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.004 | NZD | 1.535 | BOA | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.782 | | 4.267 | JPM | 132 | 0 | 132 | 0,00 |
| 02/2016 | NZD | 214 | $ | 142 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 227 | | 155 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.340 | NZD | 13.664 | UAG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 107.666 | $ | 76.324 | HUS | 562 | 0 | 562 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 2.734.764 | | 76.177 | BOA | 285 | 0 | 285 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 1.111.971 | | 34.262 | BPS | 567 | 0 | 567 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.349.526 | | 41.305 | GLM | 412 | 0 | 412 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 86.171 | | 4.990 | BRC | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 204 | MXN | 3.525 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | | 779 | | 13.297 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 04/2016 | CNY | 55.789 | $ | 8.231 | JPM | 0 | (177) | (177) | 0,00 |
| 04/2016 | $ | 9.400 | CNY | 55.789 | JPM | 0 | (992) | (992) | (0,01) |
| 05/2016 | | 381 | ZAR | 5.714 | BOA | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 566.531 | $ | 86.106 | BPS | 2.118 | 0 | 2.118 | 0,02 |
| 09/2016 | | 349.604 | | 53.180 | FBF | 1.351 | 0 | 1.351 | 0,01 |
| 09/2016 | | 434.751 | | 66.102 | JPM | 1.650 | 0 | 1.650 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 09/2016 | $ | 67.091 | CNH | 434.434 | JPM | $ 0 | $ (2.686) | $ (2.686) | (0,02) |
| 10/2016 | BRL | 264.000 | $ | 66.684 | MSB | 5.817 | 0 | 5.817 | 0,05 |
| 10/2016 | CNH | 217.721 | | 33.250 | BRC | 1.034 | 0 | 1.034 | 0,01 |
| 10/2016 | | 401.812 | | 62.109 | SCX | 2.707 | 0 | 2.707 | 0,02 |
| 01/2017 | BRL | 25.458 | | 8.961 | BPS | 3.244 | 0 | 3.244 | 0,03 |
| 01/2017 | $ | 8.961 | BRL | 25.458 | DUB | 0 | (3.244) | (3.244) | (0,03) |
| | | | | | | $ 81.277 | $ (70.830) | $ 10.447 | 0,08 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (51.328)** | **(0,40)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (h)** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | $ | (45.000) | $ (46.334) | (0,36) |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | | (7.500) | (7.937) | (0,06) |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | | (20.000) | (21.125) | (0,17) |
| | | | $ (75.396) | (0,59) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (75.396)** | **(0,59)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 1,212 % fällig am 16.05.2016 | $ | 20.250 | $ 20.214 | 0,16 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | | 31.600 | 31.626 | 0,25 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,699 % fällig am 02.05.2017 | | 41.400 | 41.391 | 0,32 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **$ 93.231** | **0,73** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 15.647.936** | **122,28** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1.382 | $ 2.037 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 59 | 59 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 818 | 595 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 121 | 83 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 144.757 | 1.204 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.635 | 1.635 | 0,01 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 5 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 904 | 107 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.429 | 12 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 5 | 4 | 0,00 |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 47 | 5 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 7 | 10 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 18 | 18 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 7 | 5 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 5 | 3 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 510 | 510 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 5 | 5 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 3 | 2 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 491 | 491 | 0,00 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 480 | 349 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 486 | 55 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 175 | 126 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4.009 | 4.355 | 0,04 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 60.970 | 507 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 436 | 643 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | $ | 12 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **12.843** | **0,10** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **(2.864.063)** | **(22,38)** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **12.796.716** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.076.107 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 110.812 und Barmittel von USD 12.862 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 50.576 und Barmittel in Höhe von USD 9.346 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 62.310 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(h) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(i) **Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AWAS Leasing 2011-I Ltd. | 4,870 % | 02.10.2021 | 24.02.2011 | $ 44.919 | $ 46.126 | 0,36 |

### (j) Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | Quoted Prices an aktiven Märkten für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 914.121 | $ 14.706.226 | $ 120.684 | $ 15.741.031 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 93.231 | 0 | 93.231 |
| Finanzderivate[3] | (13.561) | (97.328) | (41) | (110.930) |
| Leerverkäufe | 0 | (75.396) | 0 | (75.396) |
| **Summen** | **$ 900.560** | **$ 14.626.733** | **$ 120.643** | **$ 15.647.936** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | Quoted Prices an aktiven Märkten für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.018.833 | $ 10.482.657 | $ 342.283 | $ 11.843.773 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 385.425 | 0 | 385.425 |
| Finanzderivate[3] | 42.467 | 14.634 | 344 | 57.445 |
| Leerverkäufe | 0 | (69.652) | 0 | (69.652) |
| **Summen** | **$ 1.061.300** | **$ 10.813.064** | **$ 342.627** | **$ 12.216.991** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

### (k) Abgesicherte Devisenterminkontrakte

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class, Administrative CHF (Hedged) Class, Class E CHF (Hedged) und Class S CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 46.976 | CHF | 48.167 | BOA | $ 1.149 | $ (6) | $ 1.143 | 0,00 |
| 01/2016 | | 111.420 | | 112.895 | BPS | 1.362 | 0 | 1.362 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 6.576 | $ | 6.569 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.071 | CHF | 2.068 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 180.077 | $ | 182.170 | CBK | 2.273 | 0 | 2.273 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 173.619 | CHF | 177.265 | DUB | 3.469 | 0 | 3.469 | 0,03 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CHF | 45 | $ | 45 | DUB | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.075 | | 2.028 | FBF | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| 01/2016 | | 179.088 | | 181.321 | JPM | 2.412 | 0 | 2.412 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 173.648 | CHF | 177.362 | JPM | 3.537 | 0 | 3.537 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 160.804 | $ | 162.323 | MSB | 1.679 | 0 | 1.679 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 4.561 | CHF | 4.514 | MSB | 12 | (63) | (51) | 0,00 |
| 01/2016 | | 671 | | 666 | RBC | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 449 | | 443 | SOG | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 174.435 | | 177.139 | UAG | 2.527 | 0 | 2.527 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 179.088 | $ | 181.302 | UAG | 2.393 | 0 | 2.393 | 0,02 |
| 02/2016 | | 425 | | 431 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 181.645 | CHF | 179.331 | CBK | 0 | (2,26 8) | (2.268) | (0,02) |
| 02/2016 | | 181.544 | | 179.088 | JPM | 0 | (2.410) | (2.410) | (0,02) |
| 02/2016 | | 156.924 | | 155.255 | MSB | 0 | (1.630) | (1.630) | (0,01) |
| 02/2016 | | 181.512 | | 179.088 | UAG | 0 | (2.379) | (2.379) | (0,02) |
| | | | | | | $ 20.819 | $ (8.820) | $ 11.999 | 0,09 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CZK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CZK | 11.392 | $ | 458 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 6.169 | CZK | 155.000 | CBK | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 3.894 | $ | 154 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 5.307 | CZK | 133.905 | FBF | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.149 | | 155.292 | HUS | 100 | 0 | 100 | 0,00 |
| 02/2016 | | 64 | | 1.613 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.192 | | 154.832 | MSB | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | | | | | | $ 292 | $ (3) | $ 289 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Currency Exposure) Class, Class E EUR (Currency Exposure) und Class G Retail EUR (Currency Exposure) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu erhaltende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögen |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 956 | $ | 686 | AZD | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 456 | AUD | 624 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 31 | | 44 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 207 | | 288 | NAB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | CAD | 3 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 1.769 | $ | 1.274 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 399 | CAD | 532 | JPM | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | | 684 | | 917 | MSB | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 01/2016 | | 55 | | 76 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 178 | | 241 | SCX | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 285 | CHF | 292 | BOA | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 592 | $ | 599 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 166 | CHF | 170 | FBF | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 132 | | 130 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | € | 3 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.826 | | 6.425 | CBK | 152 | 0 | 152 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.680 | | 3.453 | HUS | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.780 | | 1.625 | SCX | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 11.505 | $ | 12.567 | UAG | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.106 | £ | 1.404 | BOA | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 2.489 | $ | 3.694 | CBK | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 499 | £ | 329 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.140 | | 756 | MSB | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | | 490 | JPY | 60.377 | BOA | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 3 | $ | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | JPY | 185 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 83.320 | $ | 689 | MSB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 0 | JPY | 9 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 187 | | 22.761 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 15 | NOK | 131 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 59 | NZD | 88 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 100 | | 150 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 77 | SEK | 669 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 685 | AUD | 956 | AZD | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.274 | CAD | 1.769 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 600 | CHF | 592 | CBK | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | | 12.576 | € | 11.505 | UAG | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.694 | £ | 2.489 | CBK | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | | 288 | JPY | 35.394 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | | 689 | | 83.320 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 05/2016 | | 22 | ZAR | 331 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 380 | $ (256) | $ 124 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 999.909 | $ 1.098.693 | BOA | $ 12.492 | $ 0 | $ 12.492 | 0,10 |
| 01/2016 | $ 1.087.863 | € 1.020.483 | BOA | 20.688 | 0 | 20.688 | 0,17 |
| 01/2016 | 3.936 | 3.599 | BPS | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | € 1.482 | $ 1.625 | BPS | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | 20.614 | 22.392 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 27.941 | 30.220 | CBK | 131 | (263) | (132) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 36.356 | € 33.941 | CBK | 541 | (27) | 514 | 0,00 |
| 01/2016 | 72.650 | 67.931 | DUB | 1.144 | 0 | 1.144 | 0,01 |
| 01/2016 | 626.194 | 590.987 | GLM | 15.795 | 0 | 15.795 | 0,12 |
| 01/2016 | 1.061.135 | 995.740 | HUS | 20.537 | 0 | 20.537 | 0,16 |
| 01/2016 | € 999.349 | $ 1.098.230 | HUS | 12.636 | 0 | 12.636 | 0,10 |
| 01/2016 | 696.352 | 760.950 | JPM | 4.503 | 0 | 4.503 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 1.523 | € 1.432 | NAB | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 01/2016 | € 20.633 | $ 22.412 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.975 | € 1.810 | RBC | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | 34 | 31 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 12.414 | $ 13.600 | SCX | 115 | 0 | 115 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.085.093 | € 1.021.031 | UAG | 24.053 | 0 | 24.053 | 0,18 |
| 01/2016 | € 1.004.253 | $ 1.096.947 | UAG | 6.027 | 0 | 6.027 | 0,05 |
| 02/2016 | 5.804 | 6.376 | BOA | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.098.865 | € 999.349 | BOA | 0 | (12.502) | (12.502) | (0,10) |
| 02/2016 | 1.099.008 | 999.349 | HUS | 0 | (12.645) | (12.645) | (0,10) |
| 02/2016 | 761.471 | 696.352 | JPM | 0 | (4.488) | (4.488) | (0,03) |
| 02/2016 | € 31 | $ 34 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.097.084 | € 1.003.672 | UAG | 0 | (6.022) | (6.022) | (0,05) |
| | | | | $ 118.777 | $ (35.983) | $ 82.794 | 0,65 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Administrative GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged), Class R GBP (Hedged) und Class S GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 5.442 | £ 3.615 | AZD | $ 0 | $ (113) | $ (113) | 0,00 |
| 01/2016 | 44.856 | 29.756 | BOA | 0 | (999) | (999) | (0,01) |
| 01/2016 | 636.642 | 423.037 | BPS | 0 | (13.127) | (13.127) | (0,10) |
| 01/2016 | £ 538.476 | $ 799.112 | CBK | 5.453 | 0 | 5.453 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 786.965 | £ 520.894 | CBK | 0 | (19.219) | (19.219) | (0,15) |
| 01/2016 | 786.633 | 521.818 | DUB | 0 | (17.526) | (17.526) | (0,14) |
| 01/2016 | 3.222 | 2.125 | JPM | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 524.174 | $ 777.860 | JPM | 5.280 | 0 | 5.280 | 0,04 |
| 01/2016 | 524.174 | 776.031 | MSB | 3.451 | 0 | 3.451 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 782.046 | £ 518.721 | MSB | 0 | (17.504) | (17.504) | (0,14) |
| 01/2016 | 497 | 336 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 17.281 | $ 25.469 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 450.827 | 667.213 | SCX | 2.739 | 0 | 2.739 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 4.896 | £ 3.233 | UAG | 0 | (131) | (131) | 0,00 |
| 02/2016 | 776.954 | 523.522 | CBK | 0 | (5.275) | (5.275) | (0,04) |
| 02/2016 | 777.891 | 524.174 | JPM | 0 | (5.251) | (5.251) | (0,04) |
| 02/2016 | 776.081 | 524.174 | MSB | 0 | (3.441) | (3.441) | (0,03) |
| 02/2016 | 667.263 | 450.827 | SCX | 0 | (2.738) | (2.738) | (0,02) |
| 02/2016 | 5.811 | 3.896 | UAG | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | | | | $ 16.923 | $ (85.485) | $ (68.562) | (0,54) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional HUF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | HUF 52.074 | $ 179 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 2.332 | HUF 675.921 | MSB | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 05/2016 | 2.739 | 790.732 | CBK | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 05/2016 | 2.744 | 792.373 | DUB | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 05/2016 | 2.700 | 792.559 | GLM | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | | | | $ 20 | $ (63) | $ (43) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | ILS 1.953 | $ 502 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 14.167 | ILS 54.943 | BPS | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS 213 | $ 55 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 14.135 | ILS 54.825 | DUB | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS 2.535 | $ 652 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ | 12.808 | ILS | 49.605 | MSB | $ 0 | $ (49) | $ (49) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 164 | $ | 42 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.155 | ILS | 54.771 | SOG | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (185) | $ (185) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | NOK | 388.956 | $ | 44.502 | BOA | $ 559 | $ 0 | $ 559 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 43.102 | NOK | 373.948 | BPS | 0 | (854) | (854) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK | 11.853 | $ | 1.339 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.638 | NOK | 22.911 | CBK | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 2.000 | $ | 231 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 36.273 | NOK | 315.691 | HUS | 0 | (607) | (607) | 0,00 |
| 01/2016 | | 43.116 | | 373.491 | JPM | 0 | (921) | (921) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK | 389.096 | $ | 44.879 | JPM | 920 | 0 | 920 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 577 | NOK | 5.006 | MSB | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 183 | | 1.601 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 334.695 | $ | 38.348 | SCX | 535 | 0 | 535 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 46.518 | NOK | 404.694 | SCX | 0 | (797) | (797) | (0,01) |
| 01/2016 | | 740 | | 6.500 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 389.096 | $ | 44.872 | UAG | 913 | 0 | 913 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 44.492 | NOK | 388.956 | BOA | 0 | (561) | (561) | 0,00 |
| 02/2016 | | 44.867 | | 389.096 | JPM | 0 | (921) | (921) | (0,01) |
| 02/2016 | | 411 | | 3.573 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | | 38.338 | | 334.695 | SCX | 0 | (537) | (537) | 0,00 |
| 02/2016 | | 44.860 | | 389.096 | UAG | 0 | (914) | (914) | (0,01) |
| | | | | | | $ 2.932 | $ (6.188) | $ (3.256) | (0,02) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NZD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 11 | NZD | 17 | BOA | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 1 | $ | 1 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 0 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10 | NZD | 15 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11 | | 17 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11 | | 17 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional PLN (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 2.452 | PLN | 9.537 | CBK | $ 0 | $ (37) | $ (37) | 0,00 |
| 01/2016 | PLN | 197 | $ | 50 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 1.550 | PLN | 6.000 | BOA | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 03/2016 | | 252 | | 1.000 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 05/2016 | | 2.646 | | 10.703 | BOA | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| 05/2016 | | 2.641 | | 10.684 | BPS | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| 05/2016 | | 2.290 | | 9.171 | MSB | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 05/2016 | | 2.667 | | 10.671 | SCX | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | | | | | | $ 174 | $ (70) | $ 104 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class und Administrative SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 9.472 | SEK | 82.607 | BOA | $ 326 | $ 0 | $ 326 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 78.256 | $ | 9.372 | BOA | 90 | 0 | 90 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.465 | SEK | 82.833 | BPS | 361 | 0 | 361 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK | 2.883 | $ | 342 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 80.186 | | 9.610 | CBK | 105 | (6) | 99 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.653 | SEK | 83.937 | CBK | 303 | 0 | 303 | 0,00 |
| 01/2016 | | 35 | | 297 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 1.936 | $ | 227 | DUB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 752 | | 88 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.550 | | 301 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 78.316 | | 9.355 | JPM | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| 01/2016 | | 77.783 | | 9.278 | MSB | 53 | (1) | 52 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 528 | SEK | 4.466 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 13 | $ | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.333 | SEK | 72.669 | SCX | 287 | 0 | 287 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SEK | 2.797 | $ | 320 | SCX | $ 0 | $ (12) | $ (12) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 14 | SEK | 122 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 22 | | 195 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 4.659 | $ | 543 | UAG | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.380 | SEK | 78.256 | BOA | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.394 | | 78.256 | CBK | 0 | (104) | (104) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.337 | | 78.101 | JPM | 0 | (65) | (65) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 8.550 | $ | 1.024 | MSB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.128 | SEK | 76.444 | MSB | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.602 | $ (345) | $ 1.257 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD | 216 | $ | 152 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8 | SGD | 11 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 152 | | 213 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 852 | $ | 602 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.248 | SGD | 3.186 | DUB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.364 | | 6.156 | HUS | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.373 | | 6.157 | SCX | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ (80) | $ (78) | 0,00 |

**(l) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 171.537 | $ 187.207 | $ (715) | $ 0 | $ (715) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(m) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,220 % | 22.10.2015 | 15.01.2016 | $ 23.108 | $ (23.118) | (0,18) |
| BOS | 0,220 % | 18.11.2015 | 15.01.2016 | 68.110 | (68.128) | (0,53) |
| BOS | 0,220 % | 15.12.2015 | 15.01.2016 | 2.475 | (2.475) | (0,02) |
| BOS | 0,220 % | 16.12.2015 | 15.01.2016 | 20.704 | (20.706) | (0,16) |
| BOS | 0,520 % | 19.11.2015 | 19.01.2016 | 223.704 | (223.843) | (1,75) |
| BOS | 0,900 % | 16.12.2015 | 04.01.2016 | 687 | (687) | 0,00 |
| GRE | 0,600 % | 15.12.2015 | 20.01.2016 | 12.605 | (12.608) | (0,10) |
| GRE | 0,700 % | 02.12.2015 | 08.01.2016 | 99.500 | (99.558) | (0,78) |
| GRE | 0,750 % | 16.12.2015 | 13.01.2016 | 98.250 | (98.283) | (0,77) |
| GRE | 0,850 % | 16.12.2015 | 14.01.2016 | 147.965 | (148.020) | (1,16) |
| GRE | 0,950 % | 03.12.2015 | 04.01.2016 | 7.722 | (7.728) | (0,06) |
| GRE | 1,000 % | 09.12.2015 | 11.01.2016 | 2.776 | (2.777) | (0,02) |
| IND | 0,470 % | 08.12.2015 | 20.01.2016 | 15.221 | (15.225) | (0,12) |
| IND | 0,510 % | 02.12.2015 | 13.01.2016 | 56.003 | (56.026) | (0,44) |
| IND | 0,530 % | 03.12.2015 | 03.02.2016 | 67.235 | (67.264) | (0,53) |
| JPS | 0,150 % | 03.12.2015 | 04.01.2016 | 77.134 | (77.143) | (0,60) |
| JPS | 0,360 % | 15.12.2015 | 11.01.2016 | 22.346 | (22.350) | (0,17) |
| JPS | 0,380 % | 05.11.2015 | 05.01.2016 | 201.669 | (201.790) | (1,58) |
| JPS | 0,380 % | 15.12.2015 | 05.01.2016 | 59.918 | (59.929) | (0,47) |
| JPS | 0,400 % | 10.12.2015 | 11.01.2016 | 61.229 | (61.244) | (0,48) |
| JPS | 0,650 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | 122.690 | (122.758) | (0,96) |
| MEI | 1,000 % | 04.12.2015 | 07.01.2016 | CAD 168.921 | (121.699) | (0,94) |
| NXN | 0,270 % | 21.10.2015 | 07.01.2016 | $ 41.850 | (41.873) | (0,33) |
| NXN | 0,300 % | 14.10.2015 | 14.01.2016 | 116.218 | (116.294) | (0,91) |
| NXN | 0,320 % | 21.10.2015 | 15.01.2016 | 49.619 | (49.651) | (0,39) |
| NXN | 0,330 % | 22.10.2015 | 22.01.2016 | 21.527 | (21.541) | (0,17) |
| NXN | 0,350 % | 21.10.2015 | 22.02.2016 | 158.212 | (158.323) | (1,24) |
| NXN | 0,350 % | 18.11.2015 | 22.02.2016 | 93.973 | (94.013) | (0,73) |
| SCX | 0,370 % | 15.10.2015 | 08.01.2016 | 30.868 | (30.893) | (0,24) |
| SCX | 0,410 % | 23.10.2015 | 25.01.2016 | 83.333 | (83.399) | (0,65) |
| SCX | 0,420 % | 04.12.2015 | 26.01.2016 | 133.481 | (133.525) | (1,04) |
| SCX | 0,440 % | 05.11.2015 | 05.01.2016 | 19.136 | (19.150) | (0,15) |

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 0,440 % | 09.11.2015 | 04.03.2016 | $ 170.613 | $ (170.723) | (1,33) |
| SCX | 0,440 % | 23.11.2015 | 21.01.2016 | 49.563 | (49.586) | (0,39) |
| SCX | 0,440 % | 15.12.2015 | 05.01.2016 | 59.740 | (59.752) | (0,47) |
| SCX | 0,470 % | 09.11.2015 | 09.02.2016 | 29.813 | (29.833) | (0,23) |
| SCX | 0,550 % | 08.12.2015 | 25.01.2016 | 54.766 | (54.787) | (0,43) |
| SCX | 0,560 % | 19.11.2015 | 19.01.2016 | 8.415 | (8.421) | (0,07) |
| SCX | 0,590 % | 01.12.2015 | 12.01.2016 | 14.794 | (14.801) | (0,12) |
| SCX | 0,850 % | 07.12.2015 | 15.01.2016 | 34.611 | (34.631) | (0,27) |
| SCX | 0,880 % | 07.12.2015 | 15.01.2016 | 280.612 | (280.783) | (2,19) |
| | | | | | $ (2.965.338) | (23,17) |

**(n) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| RBC | 0,667 % | 30.11.2015 | 06.01.2016 | CAD 84.687 | $ (61.016) | (0,48) |
| RBC | 0,694 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 48.002 | (34.595) | (0,27) |
| RBC | 0,697 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 28.679 | (20.668) | (0,16) |
| RBC | 0,730 % | 10.12.2015 | 11.01.2016 | 5.178 | (3.731) | (0,03) |
| | | | | | $ (120.010) | (0,94) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 26 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(o) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (113) | $ 0 | $ (113) |
| BOA | 18.160 | (24.920) | (6.760) |
| BPS | (10.351) | 5.370 | (4.981) |
| BRC | (12.821) | 13.080 | 259 |
| CBK | (11.640) | 11.100 | (540) |
| DBL | 231 | 0 | 231 |
| DUB | (7.228) | (18.210) | (25.438) |
| FBF | (2.577) | 2.360 | (217) |
| GLM | (9.274) | 3.260 | (6.014) |
| GST | (5.988) | 5.990 | 2 |
| HUS | 8.108 | (14.370) | (6.262) |
| JPM | 1.302 | (3.850) | (2.548) |
| MEI | (1.186) | 1.010 | (176) |
| MSB | (8.155) | 3.740 | (4.415) |
| MYC | (12.285) | 11.750 | (535) |
| NAB | 35 | 0 | 35 |
| RBC | (24) | 0 | (24) |
| RYL | 17 | (160) | (143) |
| SCX | 218 | (560) | (342) |
| SOG | (429) | 560 | 131 |
| UAG | 26.402 | (36.360) | (9.958) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(p) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 123,01 | 96,04 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,11) | 0,34 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,36) | (0,03) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,40) | 0,15 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (0,59) | (0,57) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,73 | 3,13 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 630.873.307 | $ 6.312.423 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 31.08.2020 | $ | 2.437.910 | 2.416.106 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 1.337.320 | 1.323.565 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 956.615 | 948.281 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 627.300 | 578.307 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 30.09.2020 | | 471.100 | 469.677 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 467.045 | 467.337 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 281.775 | 312.070 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 244.000 | 245.640 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 230.030 | 229.397 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | | 185.520 | 214.231 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 181.305 | 184.525 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 150.189 | 148.949 |
| **Province of Ontario Canada** | | | |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 | CAD | 172.000 | 129.977 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 1.176.000 | 118.952 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | € | 93.150 | 102.357 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 76.500 | 96.259 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | $ | 71.041 | 69.702 |
| **CCO Safari II LLC** | | | |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 66.900 | 66.900 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 264.000 | 65.239 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 636.906.463 | $ 6.373.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 31.08.2020 | $ | 980.700 | 980.906 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 540.150 | 536.673 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 560.350 | 519.017 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 372.495 | 363.986 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.08.2043 | | 225.400 | 260.571 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 244.000 | 237.570 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | | 204.800 | 234.833 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 205.190 | 206.057 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 30.09.2020 | | 152.850 | 152.854 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | | 146.600 | 150.615 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 150.206 | 149.789 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 127.425 | 127.663 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 76.500 | 99.592 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | | 93.150 | 98.597 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 4,000 % fällig am 07.03.2022 | £ | 52.850 | 94.650 |
| **Australia Government Bond** | | | |
| 5,500 % fällig am 21.04.2023 | AUD | 91.458 | 92.286 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | |
| 7,119 % fällig am 15.12.2017 | $ | 74.233 | 74.233 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 65.580 | 65.920 |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 46.880 | 48.648 |

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Low Duration Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Australia Government Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 (a) | AUD | 1.500 | $ 1.236 | 0,22 |
| **Westpac Banking Corp.** | | | | |
| 1,850 % fällig am 26.11.2018 | $ | 1.600 | 1.597 | 0,29 |
| | | | 2.833 | 0,51 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 23.520 | 5.332 | 0,96 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 44.500 | 9.719 | 1,75 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2019 | | 7.400 | 1.182 | 0,21 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | $ | 100 | 92 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2019 | | 200 | 153 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 200 | 151 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 600 | 448 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | £ | 100 | 91 | 0,01 |
| | | | 17.168 | 3,09 |
| **KANADA** | | | | |
| **Canada Government Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (a) | CAD | 206 | 174 | 0,03 |
| **Canadian Natural Resources Ltd.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 30.03.2016 | $ | 100 | 100 | 0,02 |
| | | | 274 | 0,05 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,512 % fällig am 14.08.2024 | | 4.100 | 4.102 | 0,74 |
| 1,615 % fällig am 19.01.2023 | | 1.421 | 1.420 | 0,25 |
| **Elm CLO Ltd.** | | | | |
| 1,715 % fällig am 17.01.2023 | | 2.744 | 2.753 | 0,50 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | |
| 1,691 % fällig am 15.07.2023 | | 2.205 | 2.198 | 0,40 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,652 % fällig am 15.08.2022 | | 2.600 | 2.594 | 0,47 |
| **Symphony CLO VIII LP** | | | | |
| 1,419 % fällig am 09.01.2023 | | 4.109 | 4.090 | 0,74 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 1,655 % fällig am 17.07.2024 | | 2.700 | 2.685 | 0,48 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,641 % fällig am 15.10.2022 | | 1.200 | 1.194 | 0,21 |
| | | | 21.036 | 3,79 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 3,000 % fällig am 25.03.2033 (a) | COP | 981.743 | 264 | 0,05 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) | DKK | 10.109 | 1.514 | 0,27 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 1,156 % fällig am 17.06.2017 | $ | 1.600 | 1.597 | 0,29 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 500 | 559 | 0,10 |
| 6,625 % fällig am 29.09.2049 | $ | 400 | 395 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 2.166 | 3.147 | 0,57 |
| **France Government Bond (a)** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 (b) | € | 11.142 | 12.463 | 2,24 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 2.543 | 2.906 | 0,52 |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 | | 2.444 | 3.035 | 0,55 |
| | | | 24.102 | 4,34 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond (a)(b)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 | | 4.339 | 4.963 | 0,89 |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 | | 3.863 | 4.304 | 0,78 |
| 1,750 % fällig am 15.04.2020 | € | 4.059 | $ 4.858 | 0,88 |
| | | | 14.125 | 2,55 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | | 1.400 | 1.420 | 0,26 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | | 200 | 202 | 0,04 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | | 300 | 301 | 0,05 |
| | | | 1.923 | 0,35 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 600 | 600 | 0,11 |
| **IRLAND** | | | | |
| **CELF Loan Partners IV PLC** | | | | |
| 0,925 % fällig am 03.05.2023 | | 1.681 | 1.659 | 0,30 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 1,046 % fällig am 27.08.2024 | € | 1.297 | 1.422 | 0,26 |
| 1,496 % fällig am 27.08.2024 | | 2.315 | 2.540 | 0,46 |
| **Harvest CLO V S.A.** | | | | |
| 0,205 % fällig am 05.04.2024 | | 908 | 976 | 0,17 |
| | | | 6.597 | 1,19 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | € | 300 | 328 | 0,06 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | $ | 800 | 908 | 0,16 |
| | | | 1.236 | 0,22 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Marche M5 Srl** | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | € | 54 | 59 | 0,01 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 153 | 163 | 0,03 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 313 | 345 | 0,06 |
| | | | 567 | 0,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (a)** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 | | 1.100 | 1.239 | 0,22 |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 37.251 | 42.698 | 7,70 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 5.974 | 7.112 | 1,28 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 5.132 | 6.441 | 1,16 |
| | | | 57.490 | 10,36 |
| Summe Italien | | | 59.293 | 10,68 |
| **JAPAN** | | | | |
| **Japan Government CPI-Linked Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 (a) | JPY | 361.048 | 3.172 | 0,57 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | € | 1.300 | 1.197 | 0,22 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (a) | MXN | 41.765 | 2.455 | 0,44 |
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 (a) | | 14.009 | 825 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (a) | | 23.250 | 1.476 | 0,27 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | | 12.355 | 719 | 0,13 |
| | | | 5.475 | 0,99 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Highlander Euro CDO III BV** | | | | |
| 0,161 % fällig am 01.05.2023 | € | 1.892 | 2.011 | 0,36 |
| **Malin CLO BV** | | | | |
| 0,124 % fällig am 07.05.2023 | | 495 | 534 | 0,10 |
| | | | 2.545 | 0,46 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **New Zealand Government Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 (a) | NZD | 12.600 | $ 8.738 | 1,57 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | | 600 | 472 | 0,09 |
| | | | 9.210 | 1,66 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | € | 2.500 | 2.763 | 0,50 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 200 | 235 | 0,04 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 600 | 611 | 0,11 |
| **BPE Financiaciones S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.05.2016 | | 2.600 | 2.849 | 0,51 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 200 | 225 | 0,04 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,550 % fällig am 30.11.2019 | | 3.108 | 3.465 | 0,63 |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 | | 200 | 214 | 0,04 |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 | | 902 | 1.076 | 0,19 |
| | | | 8.675 | 1,56 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Sweden Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 (a) | SEK | 5.800 | 788 | 0,14 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 300 | 324 | 0,06 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 202 | 0,04 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 800 | 914 | 0,16 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 900 | 945 | 0,17 |
| | | | 2.385 | 0,43 |
| **THAILAND** | | | | |
| **Thailand Government Bond (a)** | | | | |
| 1,200 % fällig am 14.07.2021 | THB | 85.114 | 2.246 | 0,40 |
| 1,250 % fällig am 12.03.2028 | | 63.283 | 1.553 | 0,28 |
| | | | 3.799 | 0,68 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 2,010 % fällig am 21.12.2020 | MXN | 2.500 | 141 | 0,02 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 600 | 662 | 0,12 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 3.300 | 4.874 | 0,88 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 190 | 381 | 0,07 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 1.302 | 2.015 | 0,36 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 100 | 104 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 2.400 | 3.602 | 0,65 |
| | | | 11.779 | 2,12 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Granite Mortgages PLC** | | | | |
| 0,717 % fällig am 20.01.2044 | $ | 29 | 29 | 0,01 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 1.800 | 2.631 | 0,47 |
| | | | 2.660 | 0,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked (a)(b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.11.2019 | | 25.554 | 39.480 | 7,12 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 | | 11.989 | 18.749 | 3,38 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 | £ | 272 | $ 503 | 0,09 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2017 | | 23.844 | 36.752 | 6,62 |
| | | | 95.484 | 17,21 |
| Summe Großbritannien | | | 109.923 | 19,81 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 700 | 700 | 0,13 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,023 % fällig am 30.03.2017 | | 600 | 599 | 0,11 |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 300 | 298 | 0,05 |
| 2,450 % fällig am 30.06.2020 | | 500 | 493 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | | 1.200 | 1.173 | 0,21 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 1.500 | 1.445 | 0,26 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2035 | | 400 | 371 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | | 600 | 551 | 0,10 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 7.000 | 435 | 0,08 |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | $ | 300 | 301 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 01.08.2025 | | 1.100 | 1.119 | 0,20 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,764 % fällig am 08.05.2017 | | 900 | 898 | 0,16 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 207 | 66 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 554 | 293 | 0,05 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 2.800 | 2.793 | 0,50 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 300 | 85 | 0,02 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.04.2018 | | 500 | 529 | 0,10 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | $ | 800 | $ 794 | 0,14 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.01.2018 | | 1.600 | 1.597 | 0,29 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 2.700 | 2.709 | 0,49 |
| | | | 17.249 | 3,11 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,172 % fällig am 25.11.2050 | | 220 | 220 | 0,04 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,428 % fällig am 15.01.2049 | | 1.438 | 1.483 | 0,27 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.03.2035 | | 65 | 65 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,420 % fällig am 15.01.2049 | | 1.449 | 1.480 | 0,27 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,809 % fällig am 12.12.2049 | | 1.360 | 1.422 | 0,25 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.01.2036 | | 1.202 | 1.173 | 0,21 |
| | | | 5.843 | 1,05 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2017 - 15.07.2024 (c)(d) | | 282.267 | 280.947 | 50,63 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 100 | 96 | 0,02 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 - 15.07.2025 | | 13.068 | 12.775 | 2,30 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 - 15.01.2024 (c) | | 18.615 | 18.670 | 3,37 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | $ | 2.421 | $ 2.133 | 0,38 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 (c) | | 7.144 | 7.286 | 1,31 |
| 1,625 % fällig am 15.01.2018 | | 341 | 351 | 0,06 |
| 1,875 % fällig am 15.07.2019 | | 334 | 355 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (c) | | 16.321 | 18.154 | 3,27 |
| 2,125 % fällig am 15.01.2019 - 15.02.2041 (d) | | 2.209 | 2.380 | 0,43 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 - 15.01.2027 (d) | | 7.118 | 8.037 | 1,45 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 (c) | | 39.759 | 40.667 | 7,33 |
| 2,625 % fällig am 15.07.2017 (c) | | 13.771 | 14.388 | 2,59 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 | | 103 | 135 | 0,02 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 (c) | | 2.260 | 2.028 | 0,37 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 - 15.11.2045 | | 4.040 | 4.024 | 0,73 |
| | | | 412.426 | 74,32 |
| Summe USA | | | 435.518 | 78,48 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (e)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 732.941 | 7.331 | 1,32 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 742.510** | **133,80** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 29 | $ (46) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 18 | 44 | 0,01 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 102 | (37) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 27 | (6) | 0,00 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 36 | (8) | 0,00 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 28 | 19 | 0,00 |
| | | | | $ (34) | (0,01) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 638 | $ 76 | $ 47 | 0,01 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,875 | 11.03.2016 | 180 | 26 | 42 | 0,01 |
| | | | | $ 102 | $ 89 | 0,02 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 180 | $ (15) | $ (2) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | 98,000 | 21.12.2016 | 638 | (15) | (9) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 180 | (7) | (12) | 0,00 |
| | | | | $ (37) | $ (23) | 0,00 |

| | |
|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ 32** **0,01** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-23 Index | (1,000 %) | 20.12.2019 | $ 15.100 | $ 168 | 0,03 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 3.100 | $ 4 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | $ 13.800 | $ 154 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 33.900 | 422 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,225 % | 16.09.2025 | 1.600 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 2.700 | (28) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 10.000 | (185) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 39.200 | 48 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 37.600 | 126 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 20.400 | (457) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,570 % | 10.02.2046 | 100 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 1.300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | € 5.000 | (21) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 39.200 | 77 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 4.500 | 76 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 11.840 | (334) | (0,06) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 20.03.2024 | JPY 300.000 | 42 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,710 % | 20.09.2029 | MXN 30.600 | (65) | (0,01) |
| | | | | | $ (157) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 15** | **0,00** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | $ 85.300 | $ 72 | $ 2 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | 11.200 | 82 | 50 | 0,01 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 38.800 | 25 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 36.300 | 29 | 2 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 29.800 | 28 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 23.06.2016 | 48.300 | 89 | 109 | 0,02 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 24.06.2016 | 48.000 | 86 | 109 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,683 % | 11.12.2017 | 4.000 | 560 | 401 | 0,07 |
| | | | | | | | $ 971 | $ 674 | 0,12 |

VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 1.100 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 1.100 | (3) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 1.100 | (2) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (7) | $ (2) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 900 | $ (38) | $ (44) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,700 | 14.01.2016 | 2.000 | (34) | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (72) | $ (46) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 11.200 | $ (89) | $ (71) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 19.01.2016 | 10.200 | (41) | (4) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 % | 19.01.2016 | 10.200 | (37) | (3) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 35.800 | (114) | (54) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 26.300 | (99) | (39) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 11.12.2017 | 16.800 | (560) | (287) | (0,05) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | RYL | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 7.600 | (27) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (967) | $ (463) | (0,08) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| Cap - OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial) - (1+3,000 % oder $ 0] | 22.06.2035 | € 1.700 | $ (78) | $ (43) | (0,01) |
| Cap - OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 % - (Referenzindex Final/Referenzindex Initial -1) - 3,000 %] | 01.06.2016 | $ 1.400 | (1) | 0 | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 243,273 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1) - 4,000 % oder $ 0] | 22.04.2024 | 1.000 | (7) | (2) | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 244,172 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1) - 4,000 % oder $ 0] | 16.05.2024 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (87) | $ (45) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | $ 0,000 | Maximal [((1+Ausübungskurs)-(Referenzindex final/anfängliche Referenzanpassungen)) oder $0] | 01.04.2019 | $ 2.100 | $ (14) | $ (19) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | 4.600 | (52) | (61) | (0,01) |
| | | | | | | $ (66) | $ (80) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | $ 100 | $ (70) | $ (10) | $ (60) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2017 | JPM | 100 | (52) | (3) | (49) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 300 | (210) | (29) | (181) | (0,04) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | MYC | 100 | (61) | (6) | (55) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 150 | (54) | (25) | (29) | (0,01) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 850 | (305) | (143) | (162) | (0,06) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 800 | (287) | (131) | (156) | (0,05) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BOA | 400 | (13) | (9) | (4) | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | 1.800 | (58) | (50) | (8) | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | HUS | 100 | (3) | (2) | (1) | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 50 | 1 | (1) | 2 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 1.020 | (1) | (7) | 6 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.113) | $ (416) | $ (697) | (0,20) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,421 % | 04.01.2021 | HUS | BRL 6.000 | $ (117) | $ 1 | $ (118) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,450 % | 04.01.2021 | HUS | 1.800 | (35) | 0 | (35) | (0,01) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 2.600 | 5 | (1) | 6 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | GLM | 5.200 | 10 | (2) | 12 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,270 % | 15.08.2016 | BRC | € 12.100 | (25) | 0 | (25) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,305 % | 15.09.2016 | CBK | 6.200 | (14) | 0 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,290 % | 15.08.2017 | CBK | 10.800 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,655 % | 15.08.2018 | CBK | 200 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,605 % | 15.09.2018 | DUB | 800 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,610 % | 15.09.2018 | UAG | 6.100 | (6) | 0 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,615 % | 15.09.2018 | FBF | 1.200 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,625 % | 15.09.2018 | BRC | 10.400 | (15) | 7 | (22) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,640 % | 15.09.2018 | CBK | 500 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.09.2018 | GLM | 700 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | CBK | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 7.000 | (9) | 6 | (15) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | GLM | 22.700 | (30) | 10 | (40) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.10.2018 | SOG | 400 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 1.180 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,320 % | 15.05.2030 | MYC | 1.100 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | BRC | 2.600 | 116 | 0 | 116 | 0,02 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | BPS | 500 | 26 | 3 | 23 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | GLM | 1.300 | 67 | 4 | 63 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | JPM | 300 | 15 | (1) | 16 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | CBK | 800 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | DUB | 2.000 | 51 | 4 | 47 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | GLM | 700 | 18 | (1) | 19 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,275 % | 15.09.2030 | CBK | 1.800 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.12.2030 | BRC | 8.000 | 38 | 12 | 26 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,358 % | 15.04.2035 | GLM | 300 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,550 % | 15.11.2044 | FBF | 200 | 24 | (1) | 25 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,450 % | 15.12.2044 | FBF | 300 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,530 % | 15.12.2044 | FBF | 400 | 42 | 3 | 39 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,130 % | 02.11.2017 | RYL | $ 14.500 | 33 | (1) | 34 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,570 % | 23.11.2020 | BOA | 12.200 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,580 % | 24.11.2020 | BPS | 2.700 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,058 % | 12.05.2025 | MYC | 2.700 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | | | | | | $ 403 | $ 42 | $ 361 | 0,07 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL 10.380 | $ 2.651 | BOA | $ 27 | $ 0 | $ 27 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 2.660 | BRL 10.380 | BOA | 12 | (48) | (36) | (0,01) |
| 01/2016 | 673 | 2.630 | BPS | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 2.630 | $ 666 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 794 | 238 | CBK | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 203 | BRL 794 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 4.965 | $ 1.271 | DUB | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.279 | BRL 4.965 | DUB | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 01/2016 | 46 | 180 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 180 | $ 47 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 156 | BRL 608 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 608 | $ 155 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.022 | BRL 3.991 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 3.991 | $ 1.195 | JPM | 186 | 0 | 186 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 1.202 | BRL 4.692 | MSB | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 4.692 | $ 1.237 | MSB | 51 | 0 | 51 | 0,01 |
| 01/2016 | CNH 9.810 | 1.515 | JPM | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 142.188 | € 129.403 | BOA | 0 | (1.617) | (1.617) | (0,29) |
| 01/2016 | € 27.663 | $ 30.453 | CBK | 403 | (1) | 402 | 0,07 |
| 01/2016 | $ 4.410 | € 4.052 | CBK | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | € 3.038 | $ 3.223 | DUB | 0 | (77) | (77) | (0,01) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 1.313 | € | 1.209 | GLM | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 145.294 | $ | 154.836 | HUS | 0 | (2.997) | (2.997) | (0,54) |
| 01/2016 | $ | 9.234 | € | 8.403 | HUS | 0 | (106) | (106) | (0,02) |
| 01/2016 | | 37.581 | | 34.401 | JPM | 108 | (319) | (211) | (0,04) |
| 01/2016 | | 54.737 | | 51.500 | NAB | 1.209 | 0 | 1.209 | 0,22 |
| 01/2016 | € | 216 | $ | 236 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.650 | | 2.867 | SOG | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.233 | € | 1.135 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 97.399 | £ | 64.730 | BOA | 0 | (1.994) | (1.994) | (0,36) |
| 01/2016 | £ | 732 | $ | 1.109 | BOA | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| 01/2016 | | 77.048 | | 116.150 | DUB | 2.589 | 0 | 2.589 | 0,47 |
| 01/2016 | $ | 22.132 | £ | 14.949 | MSB | 0 | (98) | (98) | (0,02) |
| 01/2016 | £ | 2.340 | $ | 3.518 | UAG | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 666 | £ | 441 | UAG | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.113 | INR | 73.613 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 437.700 | $ | 3.583 | GLM | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 3.617 | JPY | 437.700 | MSB | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 29.013 | $ | 25 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.374.159 | | 2.902 | FBF | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| 01/2016 | | 1.729.220 | | 1.490 | JPM | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 420 | | 146 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 85 | | 61 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.538 | | 1.783 | JPM | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| 02/2016 | BRL | 5.924 | | 1.470 | BOA | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.712 | | 938 | DUB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 10.300 | | 1.488 | HUS | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 129.403 | | 142.289 | BOA | 1.619 | 0 | 1.619 | 0,29 |
| 02/2016 | | 870 | | 956 | CBK | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.403 | | 9.241 | HUS | 106 | 0 | 106 | 0,02 |
| 02/2016 | | 2.979 | | 3.263 | JPM | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.635 | £ | 2.364 | MSB | 0 | (150) | (150) | (0,03) |
| 02/2016 | £ | 14.949 | $ | 22.133 | MSB | 98 | 0 | 98 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 1.331 | INR | 89.962 | FBF | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.877 | JPY | 354.000 | JPM | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 7.623 | $ | 62 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 437.700 | | 3.619 | MSB | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | | 374.100 | | 3.048 | SCX | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| 02/2016 | NZD | 1.315 | | 862 | HUS | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| 02/2016 | | 12.330 | | 7.997 | SCX | 0 | (423) | (423) | (0,08) |
| 02/2016 | SEK | 1.405 | | 165 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.405 | | 636 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 5.729 | | 4.069 | SCX | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| 02/2016 | THB | 137.088 | | 3.819 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 98.661 | | 3.020 | GLM | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 108 | MXN | 1.851 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 114.385 | $ | 6.560 | SOG | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| 04/2016 | BRL | 233 | | 70 | JPM | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 10.743 | | 1.630 | SCX | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 10/2016 | BRL | 10.000 | | 2.478 | BOA | 172 | 0 | 172 | 0,03 |
| 10/2016 | | 3.200 | | 771 | BPS | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| 10/2016 | | 2.410 | | 584 | CBK | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 10/2016 | | 7.900 | | 1.960 | JPM | 139 | 0 | 139 | 0,02 |
| 10/2016 | | 10 | | 2 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 12.516 | | 1.935 | SCX | 84 | 0 | 84 | 0,02 |
| 01/2017 | BRL | 6.200 | | 1.428 | BPS | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| 01/2017 | | 7.700 | | 1.780 | DUB | 51 | 0 | 51 | 0,01 |
| 01/2017 | | 15.600 | | 3.650 | GLM | 146 | 0 | 146 | 0,03 |
| 01/2017 | | 15.000 | | 3.529 | JPM | 160 | 0 | 160 | 0,03 |
| | | | | | | $ 7.784 | $ (8.239) | $ (455) | (0,08) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (1.127)** | **(0,20)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 741.430** | **133,61** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 429 | $ | 633 | 0,11 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 10 | | 10 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 4 | | 3 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 64 | | 43 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2.788 | | 23 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 285 | | 285 | 0,05 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 353 | | 51 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 1 | | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 28 | | 0 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | $ | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | | 3 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 89 | | 89 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 6 | | 6 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 0 | | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 86 | | 86 | 0,02 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 2 | | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 128 | | 139 | 0,03 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.174 | | 10 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 136 | | 200 | 0,04 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **1.592** | **0,29** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **(188.089)** | **(33,90)** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **554.933** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 122.674 (auf Basis des Abrechnungsdatums) und Barmittel in Höhe von USD 733 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 72.216 und Barmittel in Höhe von USD 510 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(d) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.485 und Barmittel in Höhe von USD 1.609 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(e) **Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(f) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 2.510 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(g) **Barmittel in Höhe von USD 414 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(h) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 7.331 | $ 735.179 | $ 0 | $ 742.510 |
| Finanzderivate[3] | 32 | (1.112) | 0 | (1.080) |
| **Summen** | **$ 7.363** | **$ 734.067** | **$ 0** | **$ 741.430** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 19 | $ 692.467 | $ 175 | $ 692.661 |
| Finanzderivate[3] | 49 | (2.352) | 0 | (2.303) |
| Leerverkäufe | 0 | (4.170) | 0 | (4.170) |
| **Summen** | **$ 68** | **$ 685.945** | **$ 175** | **$ 686.188** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(i) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CHF | 398 | $ | 389 | BOA | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.526 | CHF | 2.594 | BOA | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 76 | $ | 76 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.490 | | 2.519 | CBK | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.439 | CHF | 2.490 | DUB | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 37 | $ | 36 | FBF | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.876 | | 2.911 | JPM | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.435 | CHF | 2.487 | JPM | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 1.765 | $ | 1.782 | MSB | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.492 | | 2.523 | UAG | 33 | 0 | 33 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.449 | CHF | 2.487 | UAG | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| 02/2016 | | 2.522 | | 2.490 | CBK | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| 02/2016 | | 2.915 | | 2.876 | JPM | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.784 | | 1.765 | MSB | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.526 | | 2.492 | UAG | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | | | | | | $ 322 | $ (132) | $ 190 | 0,03 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 99.868 | $ | 109.722 | BOA | $ 1.245 | $ (8) | $ 1.237 | 0,22 |
| 01/2016 | $ | 106.977 | € | 100.336 | BOA | 2.018 | 0 | 2.018 | 0,36 |
| 01/2016 | | 10 | | 9 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 514 | $ | 564 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.069 | | 3.334 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.723 | € | 7.958 | CBK | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 8.137 | $ | 8.789 | CBK | 2 | (53) | (51) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 139 | € | 130 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 80.914 | | 76.365 | GLM | 2.041 | 0 | 2.041 | 0,37 |
| 01/2016 | € | 99.558 | $ | 109.409 | HUS | 1.259 | 0 | 1.259 | 0,23 |
| 01/2016 | $ | 103.964 | € | 97.557 | HUS | 2.012 | 0 | 2.012 | 0,36 |
| 01/2016 | € | 87.207 | $ | 95.297 | JPM | 564 | 0 | 564 | 0,10 |
| 01/2016 | | 295 | | 314 | NAB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 236 | € | 216 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 635 | | 580 | SCX | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 98.020 | $ | 107.061 | UAG | 586 | (4) | 582 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 117.398 | € | 110.490 | UAG | 2.630 | (3) | 2.627 | 0,48 |
| 02/2016 | | 109.472 | | 99.558 | BOA | 0 | (1.245) | (1.245) | (0,23) |
| 02/2016 | € | 416 | $ | 457 | BOA | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 109.486 | € | 99.558 | HUS | 0 | (1.260) | (1.260) | (0,23) |
| 02/2016 | | 95.362 | | 87.207 | JPM | 0 | (562) | (562) | (0,10) |
| 02/2016 | | 106.733 | | 97.645 | UAG | 0 | (586) | (586) | (0,11) |
| | | | | | | $ 12.369 | $ (3.813) | $ 8.556 | 1,54 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 45 | $ | 67 | AZD | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3 | | 5 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 122 | £ | 81 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.278 | | 5.501 | BPS | 0 | (170) | (170) | (0,03) |
| 01/2016 | £ | 167 | $ | 246 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.534 | | 9.698 | CBK | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 9.874 | £ | 6.536 | CBK | 0 | (241) | (241) | (0,04) |
| 01/2016 | | 9.870 | | 6.548 | DUB | 0 | (220) | (220) | (0,04) |
| 01/2016 | £ | 6.498 | $ | 9.643 | JPM | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 9.870 | £ | 6.546 | MSB | 0 | (221) | (221) | (0,04) |
| 01/2016 | £ | 6.498 | $ | 9.620 | MSB | 43 | 0 | 43 | 0,01 |
| 01/2016 | | 5.635 | | 8.340 | SCX | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 4 | £ | 3 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.634 | | 6.491 | CBK | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| 02/2016 | | 9.643 | | 6.498 | JPM | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| 02/2016 | | 9.621 | | 6.498 | MSB | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| 02/2016 | | 8.341 | | 5.635 | SCX | 0 | (34) | (34) | (0,01) |
| | | | | | | $ 210 | $ (1.062) | $ (852) | (0,15) |

**(j) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 1.605 | $ 1.752 | $ (7) | $ 0 | $ (7) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(k) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Umgekehrte Pensionsgeschäfte | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MEI | 0,700 % | 02.12.2015 | 06.01.2016 | £ 25.089 | $ (37.000) | (6,67) |
| MEI | 0,780 % | 02.12.2015 | 06.01.2016 | 40.120 | (59.171) | (10,66) |
| ULO | (0,120 %) | 29.12.2015 | 06.01.2016 | € 13.670 | (14.849) | (2,68) |
| ULO | (0,110 %) | 29.12.2015 | 06.01.2016 | 11.500 | (12.493) | (2,25) |
| | | | | | $ (123.513) | (22,26) |

**(l) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 1,013 % | 11.12.2015 | 22.01.2016 | $ 1.555 | $ (1.559) | (0,28) |
| TDM | 0,425 % | 14.10.2015 | 14.01.2016 | 25.870 | (25.911) | (4,67) |
| TDM | 0,567 % | 24.11.2015 | 05.01.2016 | 2.128 | (2.130) | (0,38) |
| TDM | 0,608 % | 19.11.2015 | 15.01.2016 | 2.932 | (2.935) | (0,53) |
| TDM | 0,608 % | 24.11.2015 | 25.01.2016 | 36.045 | (36.071) | (6,50) |
| TDM | 0,912 % | 21.12.2015 | 11.01.2016 | 4.302 | (4.307) | (0,78) |
| | | | | | $ (72.913) | (13,14) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 4 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(m) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 1 | $ 0 | $ 1 |
| BOA | 277 | (1.580) | (1.303) |
| BPS | (125) | 0 | (125) |
| BRC | 56 | 0 | 56 |
| CBK | (220) | 460 | 240 |
| DUB | 2.433 | (4.220) | (1.787) |
| FBF | 65 | 0 | 65 |
| GLM | 2.093 | (2.720) | (627) |
| HUS | (1.189) | 1.490 | 301 |
| JPM | (224) | 0 | (224) |
| MSB | (336) | 290 | (46) |
| MYC | 367 | (330) | 37 |
| NAB | 1.202 | (1.500) | (298) |
| RBC | 0 | 0 | 0 |
| RYL | 28 | 0 | 28 |
| SCX | (331) | 270 | (61) |
| SOG | (42) | 0 | (42) |
| UAG | 2.705 | (3.510) | (805) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(n) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 133,80 | 124,58 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,01 | 0,01 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,00 | (1,47) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,20) | 1,05 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (0,75) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Low Duration Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 53.019.589 | $ | 530.518 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | $ | 74.175 | | 74.577 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 56.272 | | 56.316 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 1,875 % fällig am 15.07.2015 (b) | | 53.889 | | 54.444 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2017 (b) | | 46.332 | | 46.604 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 27.521 | | 45.725 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** 0,125 % fällig am 22.11.2019 (b) | | 27.319 | | 43.913 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2018 | € | 36.831 | | 42.391 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** 1,250 % fällig am 22.11.2017 (b) | £ | 23.608 | | 38.967 |
| **US Treasury Notes** 1,750 % fällig am 31.03.2022 | $ | 26.100 | | 25.979 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 21.241 | | 24.473 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 1,700 % fällig am 15.09.2018 | € | 21.210 | | 23.916 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 17.381 | | 22.213 |
| **US Treasury Bonds** 2,500 % fällig am 15.02.2045 | $ | 24.630 | | 22.059 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | € | 16.665 | | 19.099 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 17.500 | | 17.337 |
| **US Treasury Notes** 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 16.800 | | 16.989 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 16.929 | | 16.939 |
| **US Treasury Notes** 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 14.600 | | 14.491 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 2,500 % fällig am 15.07.2016 (b) | | 12.856 | | 13.374 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 52.288.516 | $ | 523.200 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 1,875 % fällig am 15.07.2015 (b) | $ | 166.842 | | 168.328 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | | 115.217 | | 116.124 |
| **France Government Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2018 | € | 53.531 | | 62.045 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | | 37.877 | | 43.489 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond** 1,500 % fällig am 15.04.2016 (b) | | 26.047 | | 28.336 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 15.595 | | 25.935 |
| **US Treasury Notes** 1,750 % fällig am 31.03.2022 | $ | 26.100 | | 25.615 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,350 % fällig am 15.09.2024 | € | 17.943 | | 23.429 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2017 (b) | $ | 20.616 | | 20.675 |
| **US Treasury Bonds** 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 22.370 | | 19.807 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2016 (b) | | 17.699 | | 17.708 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 17.301 | | 17.193 |
| **US Treasury Notes** 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 16.800 | | 17.042 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 16.882 | | 16.801 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 15.465 | | 15.783 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 2,625 % fällig am 15.07.2017 (b) | | 14.299 | | 15.277 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 11.683 | | 14.724 |
| **US Treasury Notes** 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 14.600 | | 14.485 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** 1,375 % fällig am 15.02.2044 (b) | | 9.698 | | 10.573 |

(a) Der Global Low Duration Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **INVESTMENTFONDS (a)** | | | | |
| PIMCO Capital Securities Fund | | 6.740.712 | $ 73.069 | 5,30 |
| PIMCO Emerging Markets Corporate Bond Fund | | 1.336.886 | 12.727 | 0,93 |
| PIMCO Global Advantage Real Return Fund | | 1.700.405 | 12.719 | 0,92 |
| PIMCO Income Fund | | 19.041.430 | 237.828 | 17,25 |
| PIMCO StocksPLUS™ Fund | | 5.542.384 | 125.147 | 9,08 |
| | | | 461.490 | 33,48 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | | | | |
| 3,750 % fällig am 05.08.2020 | $ | 1.000 | 962 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 3.890 | 3.758 | 0,27 |
| | | | 4.720 | 0,34 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| Ally Financial, Inc. | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 2.000 | 2.000 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 29.09.2017 | | 7.700 | 7.710 | 0,56 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 300 | 302 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 2.600 | 2.684 | 0,20 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.600 | 1.704 | 0,12 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 10.600 | 10.853 | 0,79 |
| Banco Santander S.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 1.600 | 1.631 | 0,12 |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 6.800 | 7.756 | 0,56 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 3.800 | 4.061 | 0,29 |
| Barclays PLC | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 6.700 | 9.895 | 0,72 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 400 | 472 | 0,03 |
| BPCE S.A. | | | | |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | $ | 5.700 | 5.555 | 0,40 |
| Citigroup, Inc. | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 3.600 | 3.575 | 0,26 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 6,625 % fällig am 29.09.2049 | | 800 | 789 | 0,06 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | | 600 | 615 | 0,05 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 250 | 242 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 1.300 | 1.301 | 0,09 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 11.800 | 11.839 | 0,86 |
| International Lease Finance Corp. | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 1.400 | 1.421 | 0,10 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 3.700 | 3.950 | 0,29 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 313 | 0,02 |
| UBS Group AG | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.100 | 2.399 | 0,17 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.500 | 2.625 | 0,19 |
| | | | 83.692 | 6,07 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Daimler Finance N.A. LLC | | | | |
| 1,250 % fällig am 11.01.2016 | | 200 | 200 | 0,01 |
| DISH DBS Corp. | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 800 | 803 | 0,06 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | |
| 4,207 % fällig am 15.04.2016 | | 400 | 403 | 0,03 |
| General Motors Financial Co., Inc. | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.07.2017 | | 3.800 | 3.813 | 0,28 |
| 4,750 % fällig am 15.08.2017 | | 1.000 | 1.037 | 0,08 |
| Hellenic Railways Organization S.A. | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 5.400 | 5.455 | 0,40 |
| MGM Resorts International | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2016 | $ | 600 | $ 607 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2016 | | 3.600 | 3.675 | 0,27 |
| 7,625 % fällig am 15.01.2017 | | 6.900 | 7.211 | 0,52 |
| 10,000 % fällig am 01.11.2016 | | 1.400 | 1.483 | 0,11 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.02.2017 | | 50 | 50 | 0,00 |
| Time Warner Cable, Inc. | | | | |
| 5,850 % fällig am 01.05.2017 | | 300 | 314 | 0,02 |
| | | | 25.051 | 1,82 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Sprint Communications, Inc. | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 600 | 600 | 0,04 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 109.343 | 7,93 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| Oleo e Gas Participacoes S.A. | | | | |
| 10,000 % fällig am 11.04.2015 (b)(k) | BRL | 283 | 66 | 0,00 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| Fannie Mae | | | | |
| 6,158 % fällig am 25.03.2036 (c) | $ | 544 | 109 | 0,01 |
| Fannie Mae TBA | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | | 36.000 | 35.944 | 2,61 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 - 01.02.2046 | | 37.700 | 38.824 | 2,81 |
| Freddie Mac | | | | |
| 5,770 % fällig am 15.08.2043 (c) | | 2.069 | 371 | 0,03 |
| 11,617 % fällig am 15.05.2035 | | 331 | 354 | 0,02 |
| | | | 75.602 | 5,48 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| Treasury Inflation Protected Securities (d) | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2017 - 15.07.2024 (e)(f) | | 110.535 | 107.542 | 7,80 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 - 15.01.2024 (f) | | 28.434 | 28.512 | 2,07 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 - 15.02.2045 (g) | | 26.811 | 23.447 | 1,70 |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (f) | | 1.418 | 1.476 | 0,11 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 14.083 | 14.365 | 1,04 |
| 1,625 % fällig am 15.01.2018 (f) | | 1.249 | 1.288 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 15.07.2019 (f) | | 1.003 | 1.064 | 0,08 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 1.678 | 1.866 | 0,13 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 - 15.02.2041 | | 29.463 | 34.873 | 2,53 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (f) | | 35.405 | 40.292 | 2,92 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 (f) | | 12.524 | 14.049 | 1,02 |
| US Treasury Bonds | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 - 15.11.2045 (g) | | 17.390 | 17.332 | 1,26 |
| US Treasury Notes | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2019 (e)(f) | | 19.900 | 20.019 | 1,45 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 (h) | | 7.600 | 7.681 | 0,56 |
| | | | 313.806 | 22,76 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.08.2036 | | 5.641 | 5.144 | 0,37 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2037 | | 11.500 | 7.136 | 0,52 |
| 0,792 % fällig am 25.06.2036 | | 4.720 | 3.498 | 0,25 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust | | | | |
| 1,322 % fällig am 25.06.2035 | | 1.500 | 1.397 | 0,10 |
| Marche M5 Srl | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | € | 302 | 328 | 0,03 |
| Marche Mutui 4 Srl | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 866 | 922 | 0,07 |
| Marche Mutui Srl | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 1.776 | 1.957 | 0,14 |
| Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | $ | 1.737 | $ 971 | 0,07 |
| | | | 21.353 | 1,55 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 60.200 | 13.648 | 0,99 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 73.200 | 15.987 | 1,16 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2019 | | 10.300 | 1.646 | 0,12 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2017 | | 14.900 | 3.594 | 0,26 |
| Greece Government International Bond | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | JPY | 800.300 | 6.411 | 0,47 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 (d) | € | 5.218 | 6.320 | 0,46 |
| Mexico Government International Bond (d) | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 | MXN | 72.461 | 4.259 | 0,31 |
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 | | 13.195 | 777 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 | | 136.638 | 8.714 | 0,63 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (d)(g) | € | 2.490 | 2.774 | 0,20 |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 200 | 226 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 2.400 | 2.653 | 0,19 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 3.000 | 3.424 | 0,25 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked (d) | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (g) | £ | 40.463 | 63.277 | 4,59 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 | | 81 | 149 | 0,01 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2058 (g) | | 183 | 385 | 0,03 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 (g) | | 374 | 883 | 0,06 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (g) | | 759 | 1.843 | 0,13 |
| | | | 136.970 | 9,94 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANCIALS** | | | | |
| Avolon Holdings Ltd. | | 24.094 | 746 | 0,05 |
| Bank of America Corp. | | 659.180 | 11.094 | 0,81 |
| Citigroup, Inc. | | 206.199 | 10.671 | 0,77 |
| Fidelity & Guaranty Life | | 95.097 | 2.412 | 0,18 |
| Fifth Third Bancorp | | 541.472 | 10.883 | 0,79 |
| JPMorgan Chase & Co. | | 169.273 | 11.177 | 0,81 |
| M&T Bank Corp. | | 86.975 | 10.540 | 0,76 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | | 117.015 | 11.153 | 0,81 |
| US Bancorp | | 253.098 | 10.800 | 0,78 |
| Wells Fargo & Co. | | 202.061 | 10.984 | 0,80 |
| | | | 90.460 | 6,56 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Precision Castparts Corp. | | 34.767 | 8.066 | 0,59 |
| UTi Worldwide, Inc. (i) | | 784.349 | 5.514 | 0,40 |
| | | | 13.580 | 0,99 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| Constant Contact, Inc. | | 64.955 | 1.899 | 0,14 |
| King Digital Entertainment PLC | | 186.561 | 3.336 | 0,24 |
| | | | 5.235 | 0,38 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Airgas, Inc. | | 17.940 | 2.482 | 0,18 |
| | | | 111.757 | 8,11 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 0,520 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.11.2020 bewertet mit $1.328. Die Rückkauferlöse betragen $1.300.) | $ | 1.300 | $ 1.300 | 0,09 |
| **BNP Paribas Securities Corp.** | | | | |
| 0,200 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,330 % fällig am 31.07.2016 bewertet mit $4.083. Die Rückkauferlöse betragen $4.000.) | | 4.000 | 4.000 | 0,29 |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch Ginnie Mae 4,000 % fällig am 20.06.2044 bewertet mit $1.663. Die Rückkauferlöse betragen $1.600.) | | 1.600 | 1.600 | 0,12 |
| **Credit Suisse Securities (USA) LLC** | | | | |
| 0,550 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.08.2017 bewertet mit $919. Die Rückkauferlöse betragen $900.) | | 900 | 900 | 0,07 |
| **Deutsche Bank Securities, Inc.** | | | | |
| 0,350 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 bewertet mit $4.086. Die Rückkauferlöse betragen $4.000.) | | 4.000 | 4.000 | 0,29 |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.02.2043 bewertet mit $3.278. Die Rückkauferlöse betragen $3.200.) | | 3.200 | 3.200 | 0,23 |
| **J.P. Morgan Securities LLC** | | | | |
| 0,570 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2020 bewertet mit $1.635. Die Rückkauferlöse betragen $1.600.) | | 1.600 | 1.600 | 0,12 |
| **Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith** | | | | |
| 0,450 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 1,375 % fällig am 29.02.2020 bewertet mit $4.100. Die Rückkauferlöse betragen $4.000.) | $ | 4.000 | $ 4.000 | 0,29 |
| 0,580 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022 bewertet mit $1.636. Die Rückkauferlöse betragen $1.600.) | | 1.600 | 1.600 | 0,12 |
| **Morgan Stanley & Co. International PLC** | | | | |
| (0,360 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit €1.530. Die Rückkauferlöse betragen €1.538.) | € | 1.538 | 1.671 | 0,12 |
| (0,350 %) fällig am 12.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit €984. Die Rückkauferlöse betragen €988.) | | 988 | 1.073 | 0,08 |
| (0,350 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit €3.061. Die Rückkauferlöse betragen €3.077.) | | 3.076 | 3.342 | 0,24 |
| (0,320 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit €1.968. Die Rückkauferlöse betragen €1.984.) | | 1.984 | 2.155 | 0,15 |
| **RBS Securities, Inc.** | | | | |
| 0,350 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022 bewertet mit $4.099. Die Rückkauferlöse betragen $4.000.) | $ | 4.000 | $ 4.000 | 0,29 |
| **TD Securities (USA) LLC** | | | | |
| 0,560 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,428 % fällig am 31.10.2017 bewertet mit $3.275. Die Rückkauferlöse betragen $3.200.) | | 3.200 | 3.200 | 0,23 |
| | | | 37.641 | 2,73 |
| | | AKTIEN | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 19.327.795 | 193.317 | 14,02 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 1.466.065** | **106,34** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 94 | $ 20 | 0,00 |
| CAC 40 10 Euro January Futures | Short | 01/2016 | 10 | 0 | 0,00 |
| Euro STOXX 50 March Futures | Long | 03/2016 | 2.490 | 299 | 0,02 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 30 | (48) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 85 | (38) | 0,00 |
| FTSE 100 Index March Futures | Long | 03/2016 | 294 | 778 | 0,06 |
| FTSE MIB Index March Futures | Short | 03/2016 | 6 | 0 | 0,00 |
| H-Shares IDX January Futures | Long | 01/2016 | 538 | (837) | (0,06) |
| JPX-Nikkei 400 Index March Futures | Long | 03/2016 | 3.881 | (453) | (0,03) |
| Mini MSCI EAFE Index March Futures | Long | 03/2016 | 304 | 307 | 0,02 |
| Mini MSCI Emerging Markets Index March Futures | Long | 03/2016 | 1.183 | 1.157 | 0,08 |
| NASDAQ 100 E-mini March Futures March Futures | Long | 03/2016 | 5 | 5 | 0,00 |
| Nikkei 225 (SGX) March Futures | Short | 03/2016 | 14 | 16 | 0,00 |
| S&P 500 E-mini Index March Futures | Long | 03/2016 | 1.375 | 1.467 | 0,11 |
| S&P/TSX 60 Index March Futures | Short | 03/2016 | 6 | (3) | 0,00 |
| SPI 200 Index March Futures | Long | 03/2016 | 4 | (2) | 0,00 |
| Swiss Market Index March Futures | Long | 03/2016 | 316 | 504 | 0,04 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 929 | (386) | (0,03) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 969 | (339) | (0,03) |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 43 | (4) | 0,00 |
| | | | | $ 2.443 | 0,18 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 2.830 | $ 335 | $ 209 | 0,02 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,875 | 11.03.2016 | 820 | 120 | 189 | 0,01 |
| | | | | $ 455 | $ 398 | 0,03 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | |
| Call - Euro STOXX 50 | € 3.250,000 | 15.01.2016 | 729 | $ 498 | $ 505 | 0,04 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 820 | $ (68) | $ (7) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | 98,000 | 21.12.2016 | 2.830 | (64) | (39) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 820 | (34) | (57) | (0,01) |
| | | | | $ (166) | $ (103) | (0,01) |

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | |
| Call - Euro STOXX 50 | € 3.350,000 | 16.01.2015 | 729 | $ (217) | $ (151) | (0,01) |
| Put - S&P 500 Index | $ 1.900,000 | 29.01.2016 | 193 | (643) | (387) | (0,03) |
| Put - S&P 500 Index | 1.975,000 | 29.01.2016 | 67 | (164) | (113) | (0,01) |
| | | | | $ (1.024) | $ (651) | (0,05) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ 2.592** | **0,19** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 7.722 | $ 42 | 0,01 |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 25.400 | 314 | 0,02 |
| | | | | $ 356 | 0,03 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month Canadian Bank Bill | 2,200 % | 16.06.2026 | CAD 1.300 | $ 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | $ 36.400 | 382 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 29.800 | 371 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,225 % | 16.09.2025 | 4.400 | (39) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 11.800 | (113) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 % | 16.09.2025 | 48.400 | (606) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 109.600 | 51 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 162.800 | 547 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 61.100 | (270) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 5.300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | € 53.500 | (356) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 90.500 | 177 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.09.2025 | 1.400 | (15) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 11.730 | 30 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 23.600 | (356) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 20.03.2024 | JPY 3.560.000 | 348 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 19.09.2025 | 700.000 | 86 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 % | 20.12.2044 | 1.510.000 | 639 | 0,05 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,780 % | 06.10.2022 | MXN 40.300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,910 % | 25.11.2022 | 93.000 | (16) | 0,00 |
| | | | | | $ 864 | 0,06 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | **$ 1.220** | **0,09** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | GLM | CNH 6,244 | 12.05.2016 | $ 71.956 | $ 332 | $ 50 | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 7,000 % | 16.11.2020 | $ 162.300 | $ 2.811 | $ 551 | 0,04 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,200 % | 29.07.2016 | 50.600 | 2.189 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | 43.900 | 320 | 197 | 0,02 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 177.600 | 114 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 168.300 | 135 | 12 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,500 % | 24.08.2021 | 111.000 | 4.394 | 1.187 | 0,09 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 81.000 | 75 | 2 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 23.06.2016 | 206.300 | 382 | 464 | 0,03 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 24.06.2016 | 204.000 | 365 | 463 | 0,03 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,683 % | 11.12.2017 | 16.500 | 2.310 | 1.654 | 0,12 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 7,000 % | 16.11.2020 | 206.200 | 4.349 | 699 | 0,05 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,500 % | 24.08.2021 | 89.200 | 3.796 | 954 | 0,07 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | 422.000 | 359 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 21.599 | $ 6.193 | 0,45 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | |
| Call - MSCI Emerging Markets Index March Futures | BOA | $ 845,000 | 18.03.2016 | 16.000 | $ 227 | $ 172 | 0,01 |
| Call - MSCI Emerging Markets Index March Futures | DUB | 845,000 | 18.03.2016 | 16.347 | 233 | 176 | 0,01 |
| | | | | | $ 460 | $ 348 | 0,02 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | | |
| Put - Euro STOXX 50 | JPM | € 3.378,790 | 18.11.2016 | 23.245 | $ 1.018 | $ 468 | 0,03 |
| Call - S&P 500 Index | BOS | $ 2.100,000 | 18.03.2016 | 129 | 505 | 349 | 0,03 |
| Put - S&P 500 Index | DUB | 1.957,950 | 18.11.2016 | 42.115 | 1.024 | 679 | 0,05 |
| | | | | | $ 2.547 | $ 1.496 | 0,11 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 5.000 | $ (9) | $ (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 5.100 | (14) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 5.000 | (11) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ (34) | $ (8) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 6.300 | $ (267) | $ (309) | (0,02) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,700 | 14.01.2016 | 14.400 | (240) | (15) | 0,00 |
| | | | | | $ (507) | $ (324) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 2,340 % | 13.01.2016 | £ 57.200 | $ (710) | $ (53) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 43.900 | (349) | (277) | (0,02) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 97.100 | (311) | (147) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 62.500 | (234) | (93) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 11.12.2017 | 69.300 | (2.310) | (1.184) | (0,09) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 34.500 | (134) | (51) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | RYL | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 38.100 | (135) | (22) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (4.183) | $ (1.827) | (0,13) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | |
| Put - MSCI Emerging Markets Index March Futures | BOA | $ 735,000 | 18.03.2016 | 16.000 | $ (266) | $ (206) | (0,01) |
| Put - MSCI Emerging Markets Index March Futures | DUB | 735,000 | 18.03.2016 | 16.347 | (311) | (210) | (0,02) |
| Put - SGX Nifty 50 Index January Futures | BOA | 7.450,000 | 28.01.2016 | 1.740 | (102) | (23) | 0,00 |
| | | | | | $ (679) | $ (439) | (0,03) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF INDIZES** | | | | | | | |
| Put - Swiss Market Index | GST | CHF 8.400,000 | 15.01.2016 | 1.510 | $ (103) | $ (32) | 0,00 |
| Put - IBEX 35 Index | BOA | € 9.500,000 | 15.01.2016 | 1.230 | (175) | (207) | (0,02) |
| Put - S&P 500 Index | DEU | $ 1.925,000 | 15.01.2016 | 63 | (84) | (22) | 0,00 |
| | | | | | $ (362) | $ (261) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| Cap - OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial) - (1 + 3,000 %)*20, 0,000 %] | 22.06.2035 | € 9.300 | $ (424) | $ (237) | (0,02) |
| Cap - OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 % - (Referenzindex Final/Referenzindex Initial -1) - 3,000 %] | 01.06.2016 | $ 3.800 | (3) | 0 | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 240,718 | Maximal [0,000 % - (Referenzindex Final / Referenzindex Initial) - 1, 0] | 10.04.2020 | 10.600 | 0 | 57 | 0,01 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 244,172 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1) - 4,00 % oder $0] | 16.05.2024 | 1.500 | (11) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (438) | $ (182) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | $ 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | $ 14.000 | $ (158) | $ (185) | (0,01) |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | 233,707 | Maximal [0,000 %, Referenzindex Final / Referenzindex Initial-1) - 3,000 %] | 10.04.2020 | 10.600 | 0 | (2) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | 238,643 | Maximal (0,000 % - (Index Final/Index Initial-1) oder $0) | 02.10.2020 | 7.000 | (129) | (109) | (0,01) |
| | | | | | | $ (287) | $ (296) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | $ 5.600 | $ (2.009) | $ (927) | $ (1.082) | (0,15) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 2.000 | (718) | (326) | (392) | (0,05) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | MYC | 200 | (72) | (32) | (40) | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 4.700 | 36 | (25) | 61 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 12.400 | 95 | (62) | 157 | 0,01 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 12.500 | 93 | (11) | 104 | 0,01 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | MYC | 8.100 | 60 | (4) | 64 | 0,00 |
| State of California | 1,000 % | 20.12.2017 | CBK | 14.000 | 146 | (260) | 406 | 0,01 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 2.170 | (3) | (16) | 13 | 0,00 |
| | | | | | $ (2.372) | $ (1.663) | $ (709) | (0,17) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,700 % | 02.01.2017 | BPS | BRL 453.500 | $ (237) | $ (218) | $ (19) | (0,02) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,270 % | 15.08.2016 | BRC | € 19.900 | (42) | 0 | (42) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,525 % | 15.10.2017 | UAG | 3.300 | (5) | 3 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,540 % | 15.10.2017 | BRC | 1.600 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,550 % | 15.10.2017 | BPS | € 1.200 | $ (3) | $ 0 | $ (3) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,570 % | 15.10.2017 | DUB | 600 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | DUB | 1.800 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | JPM | 2.500 | (7) | 0 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,655 % | 15.08.2018 | CBK | 900 | (2) | (1) | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,605 % | 15.09.2018 | DUB | 1.200 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,610 % | 15.09.2018 | UAG | 900 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,625 % | 15.09.2018 | BRC | 1.400 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,640 % | 15.09.2018 | CBK | 600 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.09.2018 | GLM | 800 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | CBK | 1.100 | (1) | 1 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 2.800 | (4) | 1 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | GLM | 1.300 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.10.2018 | SOG | 800 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,190 % | 15.04.2030 | CBK | £ 3.300 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,320 % | 15.05.2030 | UAG | 4.300 | 157 | 0 | 157 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | BRC | 8.000 | 356 | (2) | 358 | 0,03 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | DUB | 4.200 | 187 | 0 | 187 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | MYC | 41.500 | 2.132 | 135 | 1.997 | 0,15 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | DUB | 1.200 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | GLM | 9.700 | 246 | (24) | 270 | 0,02 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,363 % | 15.08.2030 | DUB | 11.600 | 409 | 0 | 409 | 0,03 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,358 % | 15.04.2035 | GLM | 1.100 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,500 % | 15.10.2044 | FBF | 1.400 | 130 | (45) | 175 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,550 % | 15.11.2044 | FBF | 200 | 24 | 1 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,550 % | 05.11.2016 | RYL | $ 19.700 | (397) | 0 | (397) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,485 % | 19.11.2016 | DUB | 19.200 | (361) | 0 | (361) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,480 % | 20.11.2016 | DUB | 13.100 | (245) | 0 | (245) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,473 % | 21.11.2016 | DUB | 9.300 | (172) | 0 | (172) | (0,01) |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,065 % | 12.05.2025 | DUB | 29.500 | 621 | 0 | 621 | 0,05 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 26.08.2025 | BOA | 300 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.837 | $ (149) | $ 2.986 | 0,20 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Euro STOXX Banks (Price) Index | 142.031 | 1-Month EURIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | € 18.305 | 12.12.2016 | JPM | $ (157) | $ 0 | $ (157) | (0,01) |
| Erhalt | Tokyo Stock Exchange TOPIX Banks Index | 19.242.524 | 1-Month JPY-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | JPY 3.847.928 | 18.05.2016 | BOA | 1.113 | 0 | 1.113 | 0,08 |
| Erhalt | KOSPI 200 Index | 23.000.000 | Zero | KRW 5.533.279 | 10.03.2016 | BOA | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | Taiwan Stock Exchange Capitalization Weighted Stock Index | 60.800 | Zero | TWD 490.016 | 20.01.2016 | BOA | 414 | 15 | 399 | 0,03 |
| Erhalt | Taiwan Stock Exchange Capitalization Weighted Stock Index | 6.685.783 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 1.367 | 12.01.2043 | FBF | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| Erhalt | S&P Bank Select Industry TR Index | 27.658 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 28.023 | 31.10.2016 | JPM | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 1.375 | $ 14 | $ 1.361 | 0,10 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## VARIANZ-SWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Nikkei 225 Index | 0,001 % | 09.12.2016 | SOG | JPY 9.602.507 | $ 413 | $ 0 | $ 413 | 0,03 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 12.464 | $ | 8.939 | AZD | $ 0 | $ (129) | $ (129) | (0,01) |
| 01/2016 | | 600 | NZD | 645 | BOA | 6 | (1) | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 584 | AUD | 800 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 800 | $ | 571 | BRC | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.877 | | 2.827 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.827 | AUD | 3.877 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 2.203 | | 2.000 | DUB | 31 | (84) | (53) | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.200 | NZD | 2.363 | DUB | 34 | (17) | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.600 | $ | 1.137 | DUB | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.159 | AUD | 1.600 | HUS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.000 | NZD | 2.126 | MSB | 17 | (17) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 3.016 | AUD | 2.800 | MSB | 7 | (35) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.967 | | 12.464 | NAB | 101 | 0 | 101 | 0,01 |
| 01/2016 | | 2.813 | | 3.877 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.006 | BRL | 27.669 | BOA | 30 | (42) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 262 | | 1.000 | BOA | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.100 | $ | 529 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 27.669 | | 7.057 | BOA | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 674 | BRL | 2.567 | BPS | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.567 | $ | 640 | BPS | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.660 | | 1.995 | CBK | 311 | 0 | 311 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1.706 | BRL | 6.660 | CBK | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.651 | | 21.342 | DUB | 0 | (256) | (256) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 21.342 | $ | 5.466 | DUB | 71 | 0 | 71 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 149 | BRL | 581 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 581 | $ | 153 | GLM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14.770 | | 3.813 | JPM | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3.783 | BRL | 14.770 | JPM | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.200 | $ | 302 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 589 | BRL | 2.300 | MSB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 13.282 | $ | 3.402 | TOR | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.409 | BRL | 13.282 | TOR | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 2.997 | $ | 2.259 | BOA | 102 | 0 | 102 | 0,01 |
| 01/2016 | | 47.406 | | 34.134 | BOA | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.239 | CAD | 3.100 | CBK | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 3.613 | $ | 2.602 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.602 | CAD | 3.613 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.920 | | 3.800 | DUB | 0 | (184) | (184) | (0,01) |
| 01/2016 | CAD | 3.100 | $ | 2.290 | DUB | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| 01/2016 | | 803 | | 599 | HUS | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 23.486 | CAD | 31.296 | JPM | 0 | (957) | (957) | (0,07) |
| 01/2016 | | 2.676 | | 3.613 | SCX | 0 | (75) | (75) | (0,01) |
| 01/2016 | | 12.784 | | 17.812 | UAG | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.875 | CHF | 2.035 | BOA | 90 | (94) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 136 | € | 125 | BOA | 5 | (5) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 744 | $ | 744 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 751 | CHF | 744 | CBK | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 744 | $ | 751 | CBK | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 125 | CHF | 136 | FBF | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 35 | $ | 35 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 44.632 | | 6.893 | JPM | 127 | 0 | 127 | 0,01 |
| 01/2016 | CNY | 8.341 | | 1.273 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 125 | NOK | 1.194 | BOA | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.375 | $ | 1.509 | BOA | 19 | (4) | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.505 | € | 1.375 | BOA | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 612 | | 563 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 875 | £ | 618 | BOA | 3 | (43) | (40) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 167.309 | € | 1.250 | BOA | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 2.347 | | 250 | BOA | 13 | (7) | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 11.628 | | 1.250 | BRC | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 18.159 | | 16.793 | CBK | 111 | (27) | 84 | 0,01 |
| 01/2016 | € | 3.432 | $ | 3.745 | CBK | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.745 | € | 3.432 | CBK | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 7.081 | | 750 | DUB | 11 | (36) | (25) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 85.330 | | 625 | DUB | 2 | (32) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 2.125 | NOK | 19.678 | DUB | 77 | (162) | (85) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2.000 | SEK | 18.549 | DUB | 75 | (47) | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 13.115 | € | 1.375 | DUB | 13 | (1) | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 500 | JPY | 65.804 | DUB | 14 | (10) | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.362 | € | 1.875 | DUB | 31 | (2) | 29 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 375 | $ | 401 | DUB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.625 | £ | 1.173 | DUB | 31 | (68) | (37) | 0,00 |
| 01/2016 | | 750 | JPY | 99.997 | FBF | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 375 | $ | 398 | HUS | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 17.637 | € | 16.550 | HUS | 341 | 0 | 341 | 0,02 |
| 01/2016 | | 3.860 | | 3.548 | JPM | 6 | (12) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.638 | $ | 4.008 | JPM | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 372 | € | 500 | MSB | 21 | (26) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.432 | $ | 3.728 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 625 | £ | 462 | MSB | 9 | (7) | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 625 | NOK | 5.940 | MSB | 5 | (13) | (8) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 29 | $ | 31 | RBC | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | € | 3 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 33.248 | $ | 36.317 | UAG | 200 | 0 | 200 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 95 | £ | 63 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 255.039 | | 1.375 | BOA | 3 | (97) | (94) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 625 | JPY | 114.261 | BRC | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.661 | £ | 1.794 | CBK | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.794 | $ | 2.660 | CBK | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 375 | JPY | 67.898 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.462 | £ | 1.625 | DUB | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.688 | $ | 2.555 | DUB | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.298 | | 7.987 | MSB | 179 | 0 | 179 | 0,01 |
| 01/2016 | | 625 | JPY | 115.849 | MSB | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.704 | £ | 1.794 | SCX | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 156.106 | | 875 | SCX | 6 | (14) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.496 | INR | 624.641 | BOA | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| 01/2016 | | 982 | | 65.408 | BRC | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 974 | | 65.408 | BRC | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 65.408 | $ | 983 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 502.542 | | 7.567 | CBK | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12.389 | INR | 826.470 | CLY | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| 01/2016 | | 854 | | 56.970 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.950 | | 129.636 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.962 | | 933.639 | HUS | 112 | 0 | 112 | 0,01 |
| 01/2016 | | 204 | JPY | 25.000 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.191 | | 384.729 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.335 | | 162.500 | DUB | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 112.500 | $ | 933 | DUB | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 384.729 | | 3.126 | JPM | 0 | (73) | (73) | (0,01) |
| 01/2016 | | 175.000 | | 1.422 | MSB | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 132.297 | | 114 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.248.987 | | 8.814 | FBF | 97 | 0 | 97 | 0,01 |
| 01/2016 | | 7.867.368 | | 6.779 | JPM | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| 01/2016 | MXN | 9.000 | | 528 | BOA | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.414 | MXN | 23.961 | BPS | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | MXN | 9.500 | $ | 564 | BRC | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.961 | | 1.381 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.112 | MXN | 18.500 | DUB | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| 01/2016 | | 698 | | 12.000 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | MXN | 12.000 | $ | 700 | HUS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 550 | MYR | 2.335 | BPS | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | | 433 | | 1.901 | SCX | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 7.858 | $ | 890 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 890 | NOK | 7.858 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 907 | | 7.858 | SCX | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 3.977 | $ | 2.719 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 18.914 | | 12.317 | JPM | 0 | (631) | (631) | (0,05) |
| 01/2016 | $ | 2.637 | NZD | 3.977 | JPM | 84 | 0 | 84 | 0,01 |
| 01/2016 | NZD | 7.394 | $ | 4.833 | SCX | 0 | (229) | (229) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 845 | PEN | 2.862 | FBF | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | PEN | 2.862 | $ | 853 | HUS | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 78.868 | | 1.675 | GLM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.063 | PHP | 97.609 | JPM | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | | 304 | RUB | 21.216 | GLM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 34 | | 2.367 | SOG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.196 | | 78.603 | SOG | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| 01/2016 | | 688 | TRY | 2.029 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 2.772 | $ | 939 | SCX | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.927 | AUD | 12.464 | AZD | 129 | 0 | 129 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 2.853 | $ | 2.058 | DUB | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.155 | AUD | 11.573 | JPM | 249 | 0 | 249 | 0,02 |
| 02/2016 | BRL | 15.057 | $ | 3.737 | BOA | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 636 | BRL | 2.567 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 34.138 | CAD | 47.406 | BOA | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 2.750 | $ | 2.063 | DUB | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| 02/2016 | | 1.248 | | 941 | JPM | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.890 | CAD | 2.634 | SCX | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 149 | $ | 151 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 23.960 | CHF | 23.921 | DUB | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 167 | $ | 167 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.096 | CHF | 1.085 | DUB | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 110 | $ | 111 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 173 | | 175 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.420 | | 1.394 | SCX | 3 | (30) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 825 | COP | 2.607.413 | CBK | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 2.661.670 | $ | 907 | HUS | 72 | 0 | 72 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.238 | DKK | 8.715 | DUB | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.374 | | 23.356 | JPM | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 3.716 | $ | 4.079 | CBK | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.526 | € | 1.394 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 3.249 | $ | 3.456 | JPM | 0 | (77) | (77) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 36.342 | € | 33.248 | UAG | 0 | (199) | (199) | (0,01) |
| 02/2016 | | 50.263 | £ | 33.409 | CBK | 0 | (1.017) | (1.017) | (0,07) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | £ | 15.135 | $ | 22.861 | HUS | $ 551 | $ 0 | $ 551 | 0,04 |
| 02/2016 | $ | 3.542 | £ | 2.352 | JPM | 0 | (75) | (75) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.266 | HKD | 9.805 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 25.438 | $ | 3.284 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 550 | HKD | 4.262 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 15.150 | | 117.387 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 873 | IDR | 12.310.405 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.490 | ILS | 5.780 | DUB | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.448 | JPY | 424.100 | CBK | 81 | 0 | 81 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 480.000 | $ | 3.930 | HUS | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 62.750 | JPY | 7.721.700 | JPM | 1.493 | 0 | 1.493 | 0,11 |
| 02/2016 | JPY | 135.254 | $ | 1.100 | JPM | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | NOK | 3.350 | | 389 | HUS | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.585 | | 413 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.658 | NZD | 3.893 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | NZD | 26.308 | $ | 17.990 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.904 | NZD | 22.978 | SCX | 788 | 0 | 788 | 0,06 |
| 02/2016 | | 6.880 | SEK | 59.605 | CBK | 198 | 0 | 198 | 0,01 |
| 02/2016 | | 275 | | 2.394 | GLM | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.131 | $ | 802 | HUS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 20.354 | | 14.457 | SCX | 135 | 0 | 135 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 928 | THB | 33.331 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 437.300 | $ | 13.474 | BPS | 223 | 0 | 223 | 0,02 |
| 03/2016 | $ | 224 | MXN | 3.869 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.326 | | 23.061 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 266.468 | $ | 15.283 | SOG | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 963 | PEN | 3.305 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 03/2016 | PEN | 2.862 | $ | 836 | FBF | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 316 | RUB | 23.583 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | RUB | 23.583 | $ | 316 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | AUD | 1.800 | NZD | 1.913 | MSB | 6 | (8) | (2) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 10.618 | $ | 3.320 | JPM | 718 | 0 | 718 | 0,05 |
| 04/2016 | CAD | 3.100 | | 2.239 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 04/2016 | € | 1.250 | SEK | 11.486 | DUB | 8 | (3) | 5 | 0,00 |
| 04/2016 | £ | 463 | € | 625 | MSB | 3 | (5) | (2) | 0,00 |
| 04/2016 | NOK | 5.960 | | 625 | MSB | 13 | (5) | 8 | 0,00 |
| 04/2016 | £ | 750 | $ | 1.111 | DUB | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 04/2016 | | 875 | JPY | 155.733 | SCX | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 04/2016 | MXN | 12.000 | $ | 693 | HUS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 05/2016 | $ | 15 | HUF | 4.313 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 05/2016 | | 604 | PLN | 2.398 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 05/2016 | | 1.960 | ZAR | 29.426 | BOA | 0 | (107) | (107) | (0,01) |
| 09/2016 | CNH | 23.464 | $ | 3.560 | SCX | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| 10/2016 | BRL | 22.700 | | 5.760 | BOA | 526 | 0 | 526 | 0,04 |
| 10/2016 | | 5.800 | | 1.398 | BPS | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| 10/2016 | | 4.500 | | 1.090 | CBK | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| 10/2016 | | 27.200 | | 6.808 | JPM | 537 | 0 | 537 | 0,04 |
| 10/2016 | CNH | 294.876 | | 45.446 | BPS | 1.853 | 0 | 1.853 | 0,13 |
| 10/2016 | | 124.146 | | 19.067 | CBK | 714 | 0 | 714 | 0,05 |
| 01/2017 | BRL | 12.300 | | 2.832 | BPS | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| 01/2017 | | 15.100 | | 3.490 | DUB | 99 | 0 | 99 | 0,01 |
| 01/2017 | | 24.600 | | 5.755 | GLM | 230 | 0 | 230 | 0,02 |
| 01/2017 | | 21.200 | | 4.987 | JPM | 226 | 0 | 226 | 0,02 |
| 01/2017 | | 14.900 | | 3.406 | TOR | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| | | | | | | $ 12.803 | $ (6.132) | $ 6.671 | 0,48 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 13.674** | **0,99** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.483.551** | **107,61** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 37 | $ 27 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1.995 | 2.941 | 0,21 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 40 | 40 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 188.983 | 1.571 | 0,12 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.114 | 1.114 | 0,08 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 10 | 15 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 94 | 12 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.865 | 16 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 3 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | $ 12 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 20 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 347 | 347 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 36 | 36 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 4 | 4 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 8.569 | 1.106 | 0,08 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 95 | 6 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 335 | 335 | 0,03 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 22 | 16 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 3 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 34 | 25 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 3.875 | 4.209 | 0,31 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 630 | 928 | 0,07 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 79.597 | 662 | 0,05 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 13.442** | **0,98** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (118.375)** | **(8,59)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 1.378.618** | **100,00** |

ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der Global Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(b) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(c) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 13.673 und Barmittel von USD 1.189 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(f) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 27.566 und Barmittel in Höhe von USD 1.696 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 85.500 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(h) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.942 und Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**(i) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert in Höhe von USD 5.089 wurden als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Optionsgeschäfte regeln, zum 31. Dezember 2015 verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.860 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(k) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Oleo e Gas Participacoes S.A. | 10,000 % | 11.04.2015 | 07.04.2015 | $ 91 | $ 66 | 0,00 |

**(l) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 766.564 | $ 699.435 | $ 66 | $ 1.466.065 |
| Finanzderivate[3] | 3.149 | 12.777 | 1.560 | 17.486 |
| **Summen** | **$ 769.713** | **$ 712.212** | **$ 1.626** | **$ 1.483.551** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 654.802 | $ 715.364 | $ 165 | $ 1.370.331 |
| Finanzderivate[3] | 8.186 | 5.940 | 197 | 14.323 |
| Leerverkäufe | 0 | (127.958) | 0 | (127.958) |
| **Summen** | **$ 662.988** | **$ 593.346** | **$ 362** | **$ 1.256.696** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(m) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 1.651 | $ | 1.195 | CBK | $ 0 | $ (6) | $ (6) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.051 | AUD | 13.825 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 12.174 | $ | 8.758 | NAB | 0 | (99) | (99) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 3.012 | BRL | 11.802 | DUB | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 11.802 | $ | 3.125 | DUB | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 12.875 | CAD | 17.881 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 2.165 | $ | 1.554 | BPS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 15.716 | | 11.794 | JPM | 480 | 0 | 480 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 11.778 | | 11.471 | BOA | 0 | (295) | (295) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 13.541 | CHF | 13.375 | JPM | 0 | (180) | (180) | (0,01) |
| 01/2016 | CHF | 1.597 | $ | 1.616 | MSB | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.719 | DKK | 11.744 | BOA | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 11.744 | $ | 1.669 | HUS | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 153.111 | € | 143.607 | BOA | 2.889 | 0 | 2.889 | 0,21 |
| 01/2016 | € | 152.494 | $ | 167.505 | BOA | 1.884 | (33) | 1.851 | 0,14 |
| 01/2016 | | 2.232 | | 2.445 | BPS | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.985 | | 6.501 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 22.780 | | 24.843 | CBK | 221 | (123) | 98 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 40 | € | 37 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 290 | $ | 310 | DUB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 152.379 | € | 141.515 | GLM | 1.998 | (649) | 1.349 | 0,10 |
| 01/2016 | € | 150.694 | $ | 165.605 | HUS | 1.905 | 0 | 1.905 | 0,14 |
| 01/2016 | $ | 153.664 | € | 144.194 | HUS | 2.974 | 0 | 2.974 | 0,22 |
| 01/2016 | € | 102.432 | $ | 111.935 | JPM | 662 | 0 | 662 | 0,05 |
| 01/2016 | | 19 | | 20 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 45 | € | 41 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 8.614 | $ | 9.437 | SCX | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3 | € | 3 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 152.543 | | 143.541 | UAG | 3.385 | 0 | 3.385 | 0,25 |
| 01/2016 | € | 133.944 | $ | 146.231 | UAG | 789 | (62) | 727 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 2.878 | £ | 1.901 | BOA | 0 | (76) | (76) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 2.115 | $ | 3.145 | CBK | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 26.164 | £ | 17.673 | MSB | 0 | (116) | (116) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 17.459 | $ | 26.322 | MSB | 589 | 0 | 589 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 3.167 | HKD | 24.542 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 101.219 | $ | 1.523 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 3.356.830 | | 27.481 | GLM | 0 | (424) | (424) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 27.743 | JPY | 3.356.830 | MSB | 162 | 0 | 162 | 0,01 |
| 01/2016 | KRW | 6.865.922 | $ | 5.905 | FBF | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 5.398 | | 1.277 | UAG | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 7.443 | | 855 | HUS | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 29.411 | | 625 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.059 | RUB | 74.910 | MSB | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 74.910 | $ | 1.138 | SOG | 117 | 0 | 117 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK | 28.647 | | 3.285 | BOA | 0 | (113) | (113) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 3.436 | SEK | 28.647 | CBK | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 1.574 | $ | 533 | SCX | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 13.825 | | 10.037 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 11.802 | | 2.983 | DUB | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 17.881 | | 12.877 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 13.375 | | 13.558 | JPM | 180 | 0 | 180 | 0,01 |
| 02/2016 | DKK | 11.744 | | 1.720 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 166.068 | € | 151.029 | BOA | 0 | (1.889) | (1.889) | (0,14) |
| 02/2016 | | 165.722 | | 150.694 | HUS | 0 | (1.907) | (1.907) | (0,14) |
| 02/2016 | | 112.011 | | 102.432 | JPM | 0 | (660) | (660) | (0,05) |
| 02/2016 | € | 3 | $ | 3 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 143.573 | € | 131.349 | UAG | 0 | (788) | (788) | (0,06) |
| 02/2016 | £ | 17.673 | $ | 26.166 | MSB | 116 | 0 | 116 | 0,01 |
| 02/2016 | HKD | 14.375 | | 1.856 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 105.979 | | 13.681 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 13.416.480 | | 959 | AZD | 3 | 0 | 3 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | ILS | 565 | $ | 147 | CBK | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.012 | | 520 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 80.577 | | 1.208 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 455.218 | | 3.769 | DUB | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.356.830 | | 27.759 | MSB | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| 02/2016 | SEK | 28.647 | | 3.439 | CBK | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 2.546 | | 1.809 | SCX | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 178.206 | | 5.491 | BPS | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| 03/2016 | MXN | 30.467 | | 1.777 | GLM | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 74.910 | | 1.033 | MSB | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 05/2016 | PLN | 2.258 | | 558 | GLM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 35.469 | | 2.398 | BOA | 163 | 0 | 163 | 0,01 |
| | | | | | | $ 19.171 | $ (7.799) | $ 11.372 | 0,83 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 276 | AUD | 379 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 379 | $ | 273 | NAB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 368 | | 97 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 94 | BRL | 368 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 372 | CAD | 516 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 516 | $ | 387 | JPM | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 384 | | 374 | BOA | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 388 | CHF | 384 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 364 | $ | 52 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.215 | € | 1.106 | BOA | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 01/2016 | | 100 | | 92 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 85 | $ | 90 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.021 | | 1.088 | HUS | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 10 | | 15 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 351 | £ | 236 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 312 | $ | 474 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.389 | £ | 2.252 | BPS | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 108 | $ | 159 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.768 | £ | 3.156 | CBK | 0 | (116) | (116) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 3.112 | $ | 4.621 | CBK | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.757 | £ | 3.156 | DUB | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 3.135 | $ | 4.655 | JPM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.039 | | 4.499 | MSB | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.767 | £ | 3.162 | MSB | 0 | (107) | (107) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 2.249 | $ | 3.328 | SCX | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 3.149 | | 47 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 100.244 | | 821 | GLM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 828 | JPY | 100.244 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 214.494 | $ | 184 | FBF | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 169 | | 40 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 233 | | 27 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 33 | RUB | 2.338 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 2.338 | $ | 36 | SOG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 1.147 | | 132 | CBK | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 50 | | 17 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 379 | | 275 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 368 | | 93 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 516 | | 372 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 384 | | 389 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.106 | | 1.216 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.464 | £ | 3.008 | CBK | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.510 | | 3.039 | JPM | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.500 | | 3.039 | MSB | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.329 | | 2.249 | SCX | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 2.889 | $ | 373 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | IDR | 345.719 | | 25 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 81 | | 21 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 2.507 | | 38 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 100.244 | | 829 | MSB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 79 | | 56 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 4.765 | | 147 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 950 | | 55 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 2.338 | | 32 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 1.107 | | 76 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | $ 180 | $ (576) | $ (396) | (0,03) |

**(n) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 14.468 | $ 15.790 | $ (60) | $ 0 | $ (60) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(o) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GRE | 0,900 % | 22.12.2015 | 14.01.2016 | $ 2.662 | $ (2.662) | (0,19) |
| IND | 0,700 % | 15.10.2015 | 21.01.2016 | £ 5.437 | (8.026) | (0,58) |
| MEI | 0,780 % | 02.12.2015 | 06.01.2016 | 35.416 | (52.233) | (3,79) |
| MYI | (0,150 %) | 05.10.2015 | 14.01.2016 | € 20.779 | (22.564) | (1,64) |
| | | | | | $ (85.485) | (6,20) |

**(p) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GSC | 0,466 % | 16.11.2015 | 15.01.2016 | $ 17.719 | $ (17.742) | (1,29) |
| GSC | 0,922 % | 09.12.2015 | 08.01.2016 | 3.969 | (3.973) | (0,29) |
| | | | | | $ (21.715) | (1,58) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 11 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(q) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 3 | $ 0 | $ 3 |
| BOA | 4.637 | (5.420) | (783) |
| BOS | 349 | 0 | 349 |
| BPS | 1.940 | (2.060) | (120) |
| BRC | 364 | (370) | (6) |
| CBK | (1.411) | 1.240 | (171) |
| CLY | 70 | 0 | 70 |
| DEU | (22) | 0 | (22) |
| DUB | 977 | (2.080) | (1.103) |
| FBF | (47) | 0 | (47) |
| GLM | 874 | (3.020) | (2.146) |
| GST | (32) | 0 | (32) |
| HUS | 3.994 | (4.760) | (766) |
| JPM | 2.885 | (1.610) | 1.275 |
| MSB | 661 | (340) | 321 |
| MYC | 5.172 | (5.546) | (374) |
| NAB | (1) | 0 | (1) |
| NGF | (41) | 0 | (41) |
| RYL | (419) | 576 | 157 |
| SCX | 704 | (430) | 274 |
| SOG | 337 | (300) | 37 |
| TOR | 53 | 0 | 53 |
| UAG | 3.543 | (4.700) | (1.157) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

## (r) Vergleichsinformationen

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 106,34 | 104,35 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,19 | 0,67 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,09 | (0,68) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,99 | 1,10 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (9,75) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Multi-Asset Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 148.347.929 | $ 1.484.376 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | $ | 133.181 | 132.490 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 124.520 | 123.554 |
| US Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | 119.700 | 122.575 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.05.2022 | | 99.000 | 97.490 |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | 95.000 | 95.192 |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 84.590 | 81.651 |
| US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | | 78.600 | 78.294 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 45.407 | 75.433 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | $ | 72.400 | 72.267 |
| | | **AKTIEN** | |
| Source Physical Gold P-ETC | | 572.484 | 67.409 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 62.864 | 63.074 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 59.190 | 58.513 |
| US Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.09.2022 | | 55.800 | 55.670 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | | 60.305 | 54.656 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 53.266 | 52.784 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 41.843 | 49.836 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 51.281 | 48.947 |
| US Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 43.100 | 43.235 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 31.030 | 43.190 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 32.510 | 38.904 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 131.364.725 | $ 1.314.500 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 215.400 | 219.692 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 124.520 | 123.328 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 99.215 | 100.753 |
| US Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.05.2022 | | 99.000 | 97.794 |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | 95.000 | 93.231 |
| US Treasury Notes 2,250 % fällig am 30.04.2021 | | 88.400 | 91.974 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % fällig am 15.09.2024 | € | 60.666 | 79.321 |
| US Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | $ | 78.600 | 78.008 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | € | 65.196 | 75.453 |
| US Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.02.2045 | $ | 84.590 | 75.394 |
| | | **AKTIEN** | |
| Source Physical Gold P-ETC | | 572.484 | 67.856 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | $ | 62.400 | 62.478 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Unconstrained Bond Fund (a) | | 5.753.206 | 60.206 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.09.2022 | $ | 55.800 | 55.358 |
| US Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 54.600 | 54.496 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 53.264 | 52.682 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ (a) | | 3.357.936 | 45.937 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 44.776 | 44.690 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 31.030 | 43.329 |
| Spain Government Bond 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 32.560 | 42.932 |
| US Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045 | $ | 43.100 | 42.902 |

(a) Der Global Multi-Asset Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Australia Government Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 (a) | AUD | 100 | $ 83 | 0,01 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,390 % fällig am 28.08.2038 | | 58 | 42 | 0,00 |
| **Harvey Trust** | | | | |
| 2,425 % fällig am 11.07.2038 | | 69 | 50 | 0,00 |
| 2,435 % fällig am 11.09.2037 | | 53 | 38 | 0,00 |
| **Illawarra RMBS Trust** | | | | |
| 2,420 % fällig am 14.10.2037 | | 48 | 34 | 0,00 |
| | | | 247 | 0,01 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 16.02.2021 | $ | 950 | 1.044 | 0,04 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 113.700 | 25.777 | 1,03 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 169.400 | 36.997 | 1,47 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2018 | | 7.370 | 1.376 | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2019 | | 38.100 | 6.088 | 0,24 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2050 (a) | | 500 | 305 | 0,01 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2017 | | 35.100 | 8.468 | 0,34 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 13.218 | 2.668 | 0,11 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | $ | 700 | 534 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2018 | € | 500 | 445 | 0,02 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | $ | 450 | 413 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2019 | | 800 | 610 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 02.10.2023 | € | 400 | 272 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 07.03.2018 | | 100 | 91 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | $ | 1.100 | 828 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 2.300 | 1.719 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | £ | 400 | 365 | 0,02 |
| | | | 86.956 | 3,47 |
| **KANADA** | | | | |
| **Canada Government Bond (a)(b)** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 | CAD | 21.563 | 18.162 | 0,72 |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 | | 6.096 | 5.365 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2031 | | 10.440 | 11.732 | 0,47 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | | 22.737 | 20.861 | 0,83 |
| | | | 56.120 | 2,24 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **BlackRock Senior Income** | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.04.2019 | $ | 69 | 69 | 0,00 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 1,547 % fällig am 20.04.2022 | | 14.000 | 13.934 | 0,55 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,615 % fällig am 19.01.2023 | | 6.026 | 6.024 | 0,24 |
| **LCM XII LP** | | | | |
| 1,575 % fällig am 19.10.2022 | | 13.300 | 13.215 | 0,53 |
| **Mountain View Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 0,581 % fällig am 15.04.2019 | | 178 | 177 | 0,01 |
| **Symphony CLO X Ltd.** | | | | |
| 1,586 % fällig am 23.07.2023 | | 14.800 | 14.776 | 0,59 |
| **Venture VII CDO Ltd.** | | | | |
| 0,547 % fällig am 20.01.2022 | | 464 | 456 | 0,02 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 7.100 | 7.046 | 0,28 |
| 1,641 % fällig am 15.10.2022 | | 7.100 | 7.062 | 0,28 |
| | | | 62.759 | 2,50 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 800 | 800 | 0,03 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Denmark Government Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (a) | DKK | 408.832 | $ 61.216 | 2,44 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 1.300 | 1.345 | 0,05 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 500 | 559 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 600 | 872 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 200 | 205 | 0,01 |
| **France Government Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (a)(c) | € | 15.655 | 17.695 | 0,71 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (a) | | 2.503 | 2.790 | 0,11 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 (a) | | 4.176 | 4.671 | 0,19 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (a)(c) | | 15.562 | 17.787 | 0,71 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (a)(c) | | 22.491 | 26.471 | 1,05 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (a) | | 5.224 | 6.331 | 0,25 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (a)(c) | | 8.669 | 12.623 | 0,50 |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 (a)(c) | | 13.594 | 18.071 | 0,72 |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 (a) | | 2.566 | 3.186 | 0,13 |
| 2,250 % fällig am 25.05.2024 (c) | | 30.500 | 37.272 | 1,49 |
| 3,500 % fällig am 25.04.2020 (c) | | 17.570 | 21.968 | 0,88 |
| | | | 171.846 | 6,85 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **FMS Wertmanagement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.06.2016 | | 13.100 | 14.404 | 0,58 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 | | 5.490 | 6.070 | 0,24 |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (c) | | 18.984 | 21.151 | 0,84 |
| 1,750 % fällig am 15.04.2020 | | 8.885 | 10.636 | 0,42 |
| | | | 52.261 | 2,08 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 786.200 | 6.015 | 0,24 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 400 | 388 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 2.400 | 2.401 | 0,10 |
| | | | 2.789 | 0,11 |
| **INDIEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,753 % fällig am 30.03.2016 | | 2.600 | 2.606 | 0,10 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2019 | € | 1.200 | 1.309 | 0,05 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | | 2.400 | 2.624 | 0,11 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | $ | 5.100 | 5.103 | 0,20 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (a)** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 | € | 10.232 | 11.525 | 0,46 |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | | 4.806 | 5.509 | 0,22 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 | | 7.870 | 9.369 | 0,37 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 87.433 | 109.726 | 4,37 |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 19.484 | 26.674 | 1,06 |
| 3,100 % fällig am 15.09.2026 | | 743 | 1.007 | 0,04 |
| **Marche M5 Srl** | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | | 286 | 310 | 0,01 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 815 | 867 | 0,04 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 1.723 | 1.900 | 0,08 |
| | | | 175.923 | 7,01 |
| **JAPAN** | | | | |
| **Japan Government CPI-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2024 | JPY | 1.728.434 | 15.149 | 0,60 |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 | | 2.322.250 | 20.420 | 0,82 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2025 | JPY | 280.815 | $ 2.467 | 0,10 |
| | | | 38.036 | 1,52 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | € | 1.300 | 1.197 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 600 | 612 | 0,02 |
| | | | 1.809 | 0,07 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 3,270 % fällig am 04.01.2018 (a) | MXN | 125.000 | 7.206 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (a) | | 194.948 | 11.458 | 0,46 |
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 (a) | | 85.059 | 5.008 | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (a) | | 112.223 | 7.157 | 0,28 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (a) | | 32.508 | 2.064 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | | 1.270 | 74 | 0,00 |
| | | | 32.967 | 1,31 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Holland Mortgage-Backed Series Hermes XVIII BV** | | | | |
| 1,167 % fällig am 18.09.2044 | € | 293 | 324 | 0,01 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 16.800 | 16.969 | 0,68 |
| **Waha Aerospace BV** | | | | |
| 3,925 % fällig am 28.07.2020 | | 500 | 519 | 0,02 |
| **Wood Street CLO II BV** | | | | |
| 0,280 % fällig am 29.03.2021 | € | 63 | 68 | 0,00 |
| | | | 17.880 | 0,71 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **New Zealand Government Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 (a) | NZD | 53.208 | 36.901 | 1,47 |
| 3,000 % fällig am 15.04.2020 | | 12.698 | 8.731 | 0,35 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 (a) | | 6.732 | 5.060 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | | 4.616 | 3.628 | 0,14 |
| | | | 54.320 | 2,16 |
| **KATAR** | | | | |
| **Qatari Diar Finance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.07.2020 | $ | 2.000 | 2.211 | 0,09 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | € | 10.800 | 11.936 | 0,48 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 5.000 | 5.324 | 0,21 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 200 | 215 | 0,01 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | € | 1.500 | 1.529 | 0,06 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 600 | 674 | 0,03 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,550 % fällig am 30.11.2019 | | 7.036 | 7.844 | 0,31 |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 | | 10.599 | 11.321 | 0,45 |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 | | 4.111 | 4.904 | 0,20 |
| **Xunta de Galicia** | | | | |
| 6,131 % fällig am 03.04.2018 | | 1.300 | 1.595 | 0,06 |
| | | | 33.406 | 1,33 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Sweden Inflation-Linked Bond (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 | SEK | 44.390 | 5.349 | 0,22 |
| 0,250 % fällig am 01.06.2022 | | 2.200 | 280 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 90.770 | 12.326 | 0,49 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2020 | | 3.000 | 572 | 0,02 |
| | | | 18.527 | 0,74 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 2.800 | 2.835 | 0,11 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 5.100 | $ 5.826 | 0,23 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.600 | 5.880 | 0,24 |
| | | | 14.541 | 0,58 |
| **THAILAND** | | | | |
| **Thailand Government Bond (a)** | | | | |
| 1,200 % fällig am 14.07.2021 | THB | 319 | 8 | 0,00 |
| 1,250 % fällig am 12.03.2028 | | 445.127 | 10.922 | 0,44 |
| | | | 10.930 | 0,44 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 3.200 | 3.650 | 0,15 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 200 | 382 | 0,01 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 15.300 | 22.595 | 0,90 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.05.2018 | $ | 5.850 | 5.841 | 0,23 |
| 3,500 % fällig am 14.05.2025 | | 1.150 | 1.156 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.06.2049 | € | 2.600 | 2.987 | 0,12 |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.800 | 2.785 | 0,11 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 500 | 522 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 7.000 | 10.506 | 0,42 |
| | | | 50.424 | 2,01 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Arran Residential Mortgages Funding PLC** | | | | |
| 1,359 % fällig am 19.11.2047 | € | 2.226 | 2.425 | 0,10 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | £ | 1.758 | 2.505 | 0,10 |
| **Granite Mortgages PLC** | | | | |
| 0,329 % fällig am 20.01.2044 | € | 142 | 154 | 0,00 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 13.960 | 18.482 | 0,74 |
| **Permanent Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 15.07.2042 | € | 1.000 | 1.087 | 0,04 |
| | | | 24.653 | 0,98 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (c) | £ | 143.335 | 224.148 | 8,93 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2029 | | 25.307 | 40.866 | 1,63 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 | | 22.201 | 40.549 | 1,62 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (c) | | 5.234 | 9.684 | 0,39 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2058 | | 12.372 | 26.097 | 1,04 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 7.005 | 16.530 | 0,66 |
| 0,250 % fällig am 22.03.2052 | | 17.475 | 35.974 | 1,43 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 | | 13.502 | 32.769 | 1,30 |
| 0,750 % fällig am 22.03.2034 | | 35.534 | 65.918 | 2,63 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 | | 32.109 | 71.538 | 2,85 |
| 1,125 % fällig am 22.11.2037 | | 38.927 | 81.294 | 3,24 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 | | 30.118 | 54.424 | 2,17 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 | | 12.148 | 23.889 | 0,95 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 9.500 | 49.730 | 1,98 |
| 2,500 % fällig am 17.07.2024 | | 13.400 | 65.691 | 2,62 |
| | | | 839.101 | 33,44 |
| Summe Großbritannien | | | 914.178 | 36,43 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 1,270 % fällig am 25.04.2038 | $ | 231 | 230 | 0,01 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,132 % fällig am 15.12.2023 | € | 3.618 | 3.801 | 0,15 |
| 1,820 % fällig am 25.04.2023 | $ | 473 | 474 | 0,02 |
| | | | 4.505 | 0,18 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 10.600 | 10.600 | 0,42 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | $ | 5.900 | $ 5.930 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 8.600 | 8.880 | 0,35 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 2.200 | 2.187 | 0,09 |
| 2,450 % fällig am 30.06.2020 | | 3.400 | 3.352 | 0,13 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | | 8.000 | 7.820 | 0,31 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 9.800 | 9.437 | 0,38 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2035 | | 2.500 | 2.319 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | | 3.780 | 3.474 | 0,14 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 186.000 | 11.550 | 0,46 |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | $ | 600 | 602 | 0,02 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 7.600 | 8.386 | 0,33 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 506 | 162 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 1.355 | 716 | 0,03 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 1.100 | 311 | 0,01 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 3.500 | 3.476 | 0,14 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 1.400 | 1.405 | 0,06 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 11.300 | 11.337 | 0,45 |
| 4,750 % fällig am 21.10.2045 | | 6.500 | 6.483 | 0,26 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.11.2025 | | 5.800 | 5.654 | 0,23 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 900 | 926 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 1.700 | 1.868 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,870 % fällig am 25.04.2018 | | 12.300 | 12.221 | 0,49 |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 14.800 | 14.875 | 0,59 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc. (d)** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.03.2010 | € | 950 | 103 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.04.2011 | | 10 | 1 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | $ | 800 | 800 | 0,03 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 01.04.2017 | | 400 | 398 | 0,02 |
| | | | 135.273 | 5,39 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2035 | | 333 | 311 | 0,01 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 0,921 % fällig am 25.10.2031 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Amresco Residential Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,362 % fällig am 25.06.2029 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,681 % fällig am 15.04.2033 | | 621 | 603 | 0,02 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.09.2033 | | 11 | 11 | 0,00 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,651 % fällig am 17.02.2051 | | 608 | 616 | 0,02 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,320 % fällig am 25.08.2035 | | 108 | 109 | 0,00 |
| 2,480 % fällig am 25.08.2035 | | 139 | 139 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 25.03.2035 | | 343 | 345 | 0,01 |
| 2,924 % fällig am 25.03.2035 | | 88 | 89 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.12.2036 | | 2.629 | 2.408 | 0,10 |
| 1,072 % fällig am 25.05.2035 | | 1.008 | 888 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,082 % fällig am 25.10.2032 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,522 % fällig am 25.03.2035 | | 3.100 | 2.919 | 0,12 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,712 % fällig am 25.10.2036 | | 6.400 | 5.683 | 0,23 |
| 2,070 % fällig am 25.09.2035 | | 38 | 37 | 0,00 |
| 2,420 % fällig am 25.09.2035 | | 111 | 112 | 0,00 |
| 2,430 % fällig am 25.09.2035 | | 144 | 145 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,561 % fällig am 20.04.2035 | | 423 | 422 | 0,02 |
| 2,606 % fällig am 20.11.2034 | | 396 | 375 | 0,02 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | $ | 4 | $ 3 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 2,740 % fällig am 26.06.2035 | | 844 | 841 | 0,03 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 19.10.2045 | | 7.270 | 6.228 | 0,25 |
| **Equity One Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.04.2034 | | 44 | 37 | 0,00 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.08.2031 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.09.2031 | | 27 | 27 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 25.10.2044 | | 846 | 861 | 0,03 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,002 % fällig am 25.09.2035 | | 6.835 | 5.817 | 0,23 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 1,487 % fällig am 25.06.2035 | | 10.000 | 8.611 | 0,34 |
| **GreenPoint MTA Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2045 | | 262 | 233 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,793 % fällig am 25.09.2035 | | 121 | 122 | 0,00 |
| 2,806 % fällig am 25.09.2035 | | 401 | 411 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.03.2036 | | 4.645 | 3.742 | 0,15 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,336 % fällig am 15.05.2047 | | 648 | 660 | 0,03 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,685 % fällig am 25.07.2035 | | 1.146 | 1.138 | 0,05 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,866 % fällig am 15.09.2045 | | 147 | 155 | 0,01 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 1,191 % fällig am 15.08.2032 | | 834 | 797 | 0,03 |
| 2,609 % fällig am 20.10.2029 | | 45 | 46 | 0,00 |
| **Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,700 % fällig am 12.09.2049 | | 292 | 304 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,917 % fällig am 11.06.2049 | | 1.871 | 1.945 | 0,08 |
| **NCUA Guaranteed Notes Trust** | | | | |
| 0,646 % fällig am 06.11.2017 | | 3.943 | 3.949 | 0,16 |
| 0,829 % fällig am 08.12.2020 | | 246 | 247 | 0,01 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,712 % fällig am 25.03.2036 | | 1.500 | 1.124 | 0,04 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,952 % fällig am 25.07.2035 | | 200 | 180 | 0,01 |
| 1,442 % fällig am 25.12.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 0,561 % fällig am 25.06.2035 | | 168 | 147 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | | 4.544 | 3.102 | 0,12 |
| 4,034 % fällig am 25.06.2033 | | 40 | 40 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 19.10.2026 | | 34 | 33 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,632 % fällig am 25.09.2034 | | 1.896 | 1.892 | 0,08 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.03.2035 | | 482 | 403 | 0,02 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,572 % fällig am 15.10.2048 | | 428 | 434 | 0,02 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2045 | | 42 | 40 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.12.2045 | | 104 | 101 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.11.2045 | | 2.335 | 2.051 | 0,08 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | | 296 | 275 | 0,01 |
| 2,183 % fällig am 25.03.2033 | | 153 | 153 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,740 % fällig am 25.10.2035 | | 240 | 235 | 0,01 |
| | | | 61.632 | 2,46 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kanawha, West Virginia, Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | | 570 | 494 | 0,02 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **Morgan Stanley & Co. International PLC** | | | | |
| (0,360 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit $11.368. Die Rückkauferlöse betragen €11.433.) | € | 11.432 | $ 12.418 | 0,50 |
| (0,350 %) fällig am 12.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit $3.061. Die Rückkauferlöse betragen €3.075.) | | 3.074 | 3.340 | 0,13 |
| (0,350 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit $11.807. Die Rückkauferlöse betragen €11.873.) | | 11.871 | 12.896 | 0,51 |
| (0,320 %) fällig am 14.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch die Bundesrepublik Deutschland 0,750 % fällig am 15.04.2018 bewertet mit $6.777. Die Rückkauferlöse betragen €6.833.) | | 6.832 | 7.422 | 0,30 |
| | | | 36.076 | 1,44 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,443 % fällig am 01.09.2044 - 01.10.2044 | $ | 96 | 98 | |
| 2,836 % fällig am 01.12.2030 | | 3 | 3 | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 0,561 % fällig am 15.02.2019 | $ | 153 | $ 153 | 0,01 |
| 0,931 % fällig am 15.12.2037 | | 1.528 | 1.535 | 0,06 |
| 2,112 % fällig am 01.07.2036 | | 219 | 232 | 0,01 |
| 2,237 % fällig am 01.09.2036 | | 272 | 287 | 0,01 |
| 2,409 % fällig am 01.10.2036 | | 101 | 107 | 0,01 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,795 % fällig am 16.11.2029 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.04.2030 - 20.05.2030 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2030 - 20.06.2030 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 20.05.2030 | | 44 | 44 | 0,00 |
| **Small Business Administration** | | | | |
| 7,220 % fällig am 01.11.2020 | | 13 | 14 | 0,00 |
| | | | 2.504 | 0,10 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2016 - 15.07.2024 (c)(e) | | 398.335 | 392.280 | 15,63 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b)(c) | | 101.382 | 99.154 | 3,95 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 - 15.02.2043 (c)(e) | | 137.236 | 136.917 | 5,46 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 - 15.02.2045 | | 28.373 | 24.870 | 0,99 |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (c)(e)(f) | | 63.580 | 66.178 | 2,64 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 (c) | | 113.379 | 115.647 | 4,61 |
| 1,625 % fällig am 15.01.2018 (e)(f) | | 3.292 | 3.397 | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2016 - 15.01.2026 (b)(c)(e) | | 128.479 | 141.793 | 5,65 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 - 15.02.2041 (c) | | 89.094 | 105.562 | 4,21 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 - 15.01.2027 (c)(e) | $ | 143.985 | $ 164.714 | 6,56 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 (e) | | 29.806 | 31.337 | 1,25 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 | | 19.572 | 25.622 | 1,02 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | | 11.820 | 16.082 | 0,64 |
| | | | 1.323.553 | 52,74 |
| Summe USA | | | 1.564.037 | 62,33 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (g)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 10.039.594 | 100.416 | 4,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 3.495.776** | **139,31** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 30 | $ 45 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 437 | 1.132 | 0,04 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 593 | (255) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.643 | (811) | (0,03) |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 494 | 657 | 0,03 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 134 | 105 | 0,00 |
| | | | | $ 873 | 0,03 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 2.672 | $ 317 | $ 197 | 0,01 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,875 | 11.03.2016 | 794 | 117 | 183 | 0,01 |
| | | | | $ 434 | $ 380 | 0,02 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | £ 99,250 | 11.03.2016 | 794 | $ (66) | $ (7) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | 98,000 | 21.12.2016 | 2.672 | (61) | (37) | 0,00 |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling Mid-Curve March Futures | 98,625 | 11.03.2016 | 794 | (33) | (55) | 0,00 |
| | | | | $ (160) | $ (99) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | $ 1.154 | **0,05** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-23 Index | (1,000 %) | 20.12.2019 | $ 164.600 | $ 1.846 | 0,07 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 13.100 | $ 16 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 306.300 | $ 596 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 72.100 | 795 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,225 % | 16.09.2025 | 8.200 | (73) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 14.100 | (135) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 % | 16.09.2025 | 45.700 | (572) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 14.200 | (262) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 179.800 | 167 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 60.400 | 203 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 48.100 | (219) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 125.200 | (4.659) | (0,19) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,570 % | 10.02.2046 | 1.300 | 30 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 6.200 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | € 24.300 | (207) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 168.000 | 330 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 39.470 | (460) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 7.560 | (38) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,145 % | 02.04.2020 | MXN 195.700 | (49) | 0,00 |
| | | | | | $ (4.553) | (0,18) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (2.691)** | **(0,11)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | $ 51.700 | $ 377 | $ 232 | 0,01 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 165.500 | 106 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 157.100 | 126 | 11 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 149.500 | 138 | 3 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 675.000 | 710 | 46 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 23.06.2016 | 205.800 | 381 | 463 | 0,02 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,000 % | 24.06.2016 | 203.800 | 365 | 462 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,683 % | 11.12.2017 | 15.000 | 2.100 | 1.504 | 0,06 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | 398.200 | 339 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 4.642 | $ 2.731 | 0,11 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Real Return Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 5.100 | $ (9) | $ (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 5.000 | (14) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 5.100 | (11) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ (34) | $ (8) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 5.900 | $ (250) | $ (289) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,700 | 14.01.2016 | 13.500 | (225) | (14) | 0,00 |
| | | | | | $ (475) | $ (303) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 51.700 | $ (411) | $ (326) | (0,02) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 19.01.2016 | 42.900 | (172) | (16) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 % | 19.01.2016 | 42.900 | (156) | (14) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 187.000 | (598) | (282) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 82.600 | (310) | (123) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 11.12.2017 | 63.000 | (2.100) | (1.077) | (0,04) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | NGF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 33.800 | (131) | (50) | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | RYL | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 35.200 | (125) | (21) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (4.003) | $ (1.909) | (0,08) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| Cap - OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial)-(1+3,000 %)*20, 0,000 %] | 22.06.2035 | € 8.800 | $ (401) | $ (224) | (0,01) |
| Cap - OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 %-(Referenzindex Final/Referenzindex Initial-1)-3,000 %] | 01.06.2016 | $ 7.200 | (6) | 0 | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 243,273 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1)-4,00 % oder $0] | 22.04.2024 | 37.600 | (274) | (57) | 0,00 |
| Cap - OTC CPURNSA Index | JPM | 244,172 | Maximal [(Index Final/Index Initial-1)-4,00 % oder $0] | 16.05.2024 | 3.100 | (22) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | $ (703) | $ (286) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 216,687 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 07.04.2020 | $ 26.500 | $ (236) | $ (15) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | 217,965 | Maximal [1-(Final Index/Initial Index), 0] | 29.09.2020 | 3.000 | (39) | (2) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | DUB | 233,546 | Maximal [((1+Ausübungskurs)-(Referenzindex final/anfängliche Referenzanpassungen)) oder $0] | 22.01.2018 | 9.200 | (89) | (46) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | JPM | 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | 31.300 | (354) | (413) | (0,02) |
| | | | | | | $ (718) | $ (476) | (0,02) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | $ 3.900 | $ (10) | $ (261) | $ 251 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 900 | (2) | (62) | 60 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | 1.600 | (52) | (53) | 1 | (0,01) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 4.420 | (7) | (34) | 27 | 0,00 |
| | | | | | $ (71) | $ (410) | $ 339 | (0,01) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,450 % | 04.01.2021 | FBF | BRL 8.300 | $ (161) | $ 0 | $ (161) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,450 % | 04.01.2021 | HUS | 6.800 | (132) | 0 | (132) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,500 % | 04.01.2021 | BPS | 17.100 | (204) | 0 | (204) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,500 % | 04.01.2021 | HUS | 3.600 | (43) | 0 | (43) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | BPS | 10.800 | 20 | (5) | 25 | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | GLM | 24.900 | 47 | (13) | 60 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,525 % | 15.10.2017 | UAG | € 10.500 | (16) | 8 | (24) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,540 % | 15.10.2017 | BRC | 5.700 | (11) | 0 | (11) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,550 % | 15.10.2017 | BPS | 3.800 | (8) | 0 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,570 % | 15.10.2017 | DUB | 1.900 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | DUB | 5.300 | (15) | (1) | (14) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | JPM | 7.700 | (21) | 0 | (21) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,420 % | 15.08.2018 | BRC | 12.400 | 65 | 13 | 52 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,470 % | 15.08.2018 | FBF | 28.100 | 101 | (6) | 107 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,600 % | 15.08.2018 | BRC | 80.300 | (57) | (46) | (11) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,655 % | 15.08.2018 | CBK | 7.500 | (19) | (10) | (9) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,605 % | 15.09.2018 | DUB | 6.500 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,610 % | 15.09.2018 | UAG | 2.900 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,623 % | 15.09.2018 | MYC | 7.940 | (11) | 0 | (11) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,625 % | 15.09.2018 | BRC | 58.060 | (82) | 41 | (123) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,640 % | 15.09.2018 | CBK | 4.000 | (8) | 0 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.09.2018 | GLM | 22.300 | (50) | (30) | (20) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | CBK | 6.000 | (8) | 0 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 17.700 | (24) | 9 | (33) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | GLM | 14.700 | (20) | 3 | (23) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.10.2018 | SOG | 5.200 | (12) | 2 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 15.310 | 147 | 0 | 147 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,195 % | 15.04.2030 | UAG | 10.600 | 97 | 1 | 96 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | BRC | 5.900 | 150 | (66) | 216 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | DUB | 1.800 | 46 | 3 | 43 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | GLM | 9.900 | 251 | (28) | 279 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,275 % | 15.09.2030 | CBK | 6.100 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,306 % | 08.04.2035 | BOA | 19.500 | (167) | 0 | (167) | (0,01) |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,335 % | 15.04.2035 | FBF | 1.400 | 3 | 1 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,500 % | 15.10.2044 | FBF | 1.600 | 149 | (53) | 202 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,550 % | 15.11.2044 | FBF | 1.300 | 157 | (2) | 159 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,935 % | 23.10.2016 | RYL | $ 26.500 | (815) | (47) | (768) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,930 % | 31.10.2016 | RYL | 28.000 | (860) | 0 | (860) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,935 % | 31.10.2016 | FBF | 14.800 | (457) | 0 | (457) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,860 % | 05.11.2016 | DUB | 29.600 | (847) | 1 | (848) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,825 % | 29.11.2016 | BPS | 1.800 | (50) | 0 | (50) | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,825 % | 29.11.2016 | DUB | 27.400 | (760) | (8) | (752) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,360 % | 28.01.2017 | DUB | 76.700 | (4.195) | 0 | (4.195) | (0,17) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,415 % | 12.02.2017 | GLM | 23.400 | (1.312) | 0 | (1.312) | (0,05) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,250 % | 15.07.2017 | RYL | 17.600 | (1.038) | 34 | (1.072) | (0,04) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,010 % | 16.10.2017 | BOA | 10.300 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,175 % | 01.10.2018 | GLM | 10.000 | (499) | (6) | (493) | (0,02) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,173 % | 01.11.2018 | DUB | 13.800 | (689) | 0 | (689) | (0,03) |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,570 % | 23.11.2020 | BOA | 35.900 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 2,500 % | 15.07.2022 | DUB | 38.000 | (4.135) | 862 | (4.997) | (0,17) |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,058 % | 12.05.2025 | MYC | 24.300 | 493 | 0 | 493 | 0,02 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 26.08.2025 | BOA | 500 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | $ (14.848) | $ 657 | $ (15.505) | (0,59) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Global Real Return Fund (Forts.)

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 4.106 | $ | 2.985 | BOA | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 29.277 | | 7.449 | BOA | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.341 | BRL | 29.277 | BOA | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.309 | | 24.636 | CBK | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 24.636 | $ | 7.378 | CBK | 1.151 | 0 | 1.151 | 0,05 |
| 01/2016 | | 68.903 | | 17.610 | DUB | 194 | 0 | 194 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 18.243 | BRL | 68.903 | DUB | 0 | (827) | (827) | (0,03) |
| 01/2016 | BRL | 698 | $ | 184 | GLM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 179 | BRL | 698 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 45.997 | $ | 11.820 | JPM | 194 | 0 | 194 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 11.780 | BRL | 45.997 | JPM | 0 | (153) | (153) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 2.769 | $ | 705 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 709 | BRL | 2.769 | MSB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.030 | | 31.289 | TOR | 0 | (121) | (121) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 31.289 | $ | 8.013 | TOR | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 54.487 | CAD | 75.672 | BOA | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 57.390 | | 76.220 | HUS | 0 | (2.520) | (2.520) | (0,10) |
| 01/2016 | CAD | 75.672 | $ | 56.847 | MSB | 2.371 | 0 | 2.371 | 0,09 |
| 01/2016 | CHF | 114 | | 111 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 41.971 | | 6.482 | JPM | 119 | 0 | 119 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 106.318 | | 15.107 | BOA | 0 | (369) | (369) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 5.430 | DKK | 37.395 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 326.092 | $ | 46.339 | HUS | 0 | (1.129) | (1.129) | (0,05) |
| 01/2016 | $ | 444 | € | 409 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 462.566 | $ | 493.181 | BOA | 0 | (9.305) | (9.305) | (0,37) |
| 01/2016 | $ | 1.102 | € | 1.029 | BPS | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.619 | | 21.700 | CBK | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| 01/2016 | | 158.823 | | 149.726 | CBK | 3.829 | 0 | 3.829 | 0,15 |
| 01/2016 | € | 11.611 | $ | 12.606 | CBK | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.751 | | 13.528 | DUB | 0 | (324) | (324) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 7.839 | € | 7.219 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 486.821 | | 442.989 | HUS | 0 | (5.601) | (5.601) | (0,22) |
| 01/2016 | | 8.063 | | 7.333 | JPM | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 227 | $ | 248 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.170 | | 4.511 | SOG | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.807 | € | 10.851 | UAG | 58 | (78) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 12.315 | $ | 18.573 | BOA | 422 | 0 | 422 | 0,02 |
| 01/2016 | | 4 | | 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 18.626 | £ | 12.399 | BOA | 0 | (351) | (351) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 192.483 | $ | 290.803 | CBK | 7.102 | 0 | 7.102 | 0,28 |
| 01/2016 | $ | 652.677 | £ | 439.796 | CBK | 0 | (4.462) | (4.462) | (0,18) |
| 01/2016 | £ | 17 | $ | 25 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 232.920 | £ | 155.944 | CBK | 0 | (3.073) | (3.073) | (0,12) |
| 01/2016 | | 9.135 | | 6.118 | DUB | 0 | (118) | (118) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 455.804 | $ | 687.126 | DUB | 15.317 | 0 | 15.317 | 0,61 |
| 01/2016 | | 12.423 | | 18.688 | JPM | 378 | 0 | 378 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 298.622 | £ | 201.705 | MSB | 0 | (1.328) | (1.328) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 101 | $ | 149 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.060 | | 19.681 | UAG | 432 | 0 | 432 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 39.160 | £ | 26.067 | UAG | 0 | (740) | (740) | (0,03) |
| 01/2016 | | 9.885 | INR | 653.488 | JPM | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 5.555.700 | $ | 45.483 | GLM | 0 | (701) | (701) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 45.916 | JPY | 5.555.700 | MSB | 268 | 0 | 268 | 0,01 |
| 01/2016 | KRW | 124.174 | $ | 107 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14.341.698 | | 12.334 | FBF | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| 01/2016 | | 7.398.506 | | 6.375 | JPM | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.062 | NZD | 3.067 | BOA | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 72.824 | $ | 47.420 | CBK | 0 | (2.436) | (2.436) | (0,10) |
| 01/2016 | $ | 646 | SEK | 5.656 | BPS | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | | 17.287 | | 145.469 | CBK | 118 | (150) | (32) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 9.985 | $ | 1.146 | DUB | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| 01/2016 | | 59.650 | | 7.019 | HUS | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| 01/2016 | | 30.685 | | 3.531 | SCX | 0 | (108) | (108) | 0,00 |
| 01/2016 | | 50.805 | | 5.849 | UAG | 0 | (177) | (177) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 363 | TRY | 1.073 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 29.277 | $ | 7.267 | BOA | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 10.124 | BRL | 40.064 | DUB | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 75.672 | $ | 54.493 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.476 | | 1.858 | DUB | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 37.373 | | 5.309 | DUB | 0 | (137) | (137) | (0,01) |
| 02/2016 | | 395.015 | | 57.929 | JPM | 383 | 0 | 383 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 2.132 | | 2.343 | CBK | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 02/2016 | | 442.989 | | 487.166 | HUS | 5.605 | 0 | 5.605 | 0,22 |
| 02/2016 | $ | 1.610 | € | 1.470 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 439.796 | $ | 652.697 | CBK | 4.431 | 0 | 4.431 | 0,18 |
| 02/2016 | $ | 19.545 | £ | 13.127 | JPM | 0 | (195) | (195) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 201.705 | $ | 298.641 | MSB | 1.324 | 0 | 1.324 | 0,05 |
| 02/2016 | $ | 8.528 | INR | 576.249 | FBF | 112 | 0 | 112 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 97.875 | $ | 796 | JPM | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.555.700 | | 45.942 | MSB | 0 | (271) | (271) | (0,01) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | NZD | 10.089 | $ | 6.610 | HUS | $ 0 | $ (280) | $ (280) | (0,01) |
| 02/2016 | | 69.757 | | 47.701 | JPM | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 112.747 | | 13.534 | CBK | 150 | 0 | 150 | 0,01 |
| 02/2016 | | 46.212 | | 5.309 | GLM | 0 | (179) | (179) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 24.439 | | 17.359 | SCX | 162 | 0 | 162 | 0,01 |
| 02/2016 | THB | 556.604 | | 15.504 | BOA | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.447 | THB | 159.898 | HUS | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 573.739 | $ | 17.678 | BPS | 292 | 0 | 292 | 0,01 |
| 03/2016 | MXN | 817.472 | | 46.871 | BPS | 0 | (224) | (224) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 412 | MXN | 7.115 | BRC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 81.450 | $ | 24.430 | JPM | 4.470 | 0 | 4.470 | 0,18 |
| 05/2016 | ZAR | 1.755 | | 121 | MSB | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 46.203 | | 7.010 | SCX | 168 | 0 | 168 | 0,01 |
| 10/2016 | BRL | 21.000 | | 5.329 | BOA | 487 | 0 | 487 | 0,02 |
| 10/2016 | | 13.100 | | 3.156 | BPS | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| 10/2016 | | 46.800 | | 11.322 | CBK | 533 | 0 | 533 | 0,02 |
| 10/2016 | | 32.800 | | 8.142 | JPM | 579 | 0 | 579 | 0,02 |
| 10/2016 | CNH | 52.783 | | 8.159 | SCX | 356 | 0 | 356 | 0,01 |
| 01/2017 | BRL | 29.100 | | 6.701 | BPS | 166 | 0 | 166 | 0,01 |
| 01/2017 | | 35.600 | | 8.227 | DUB | 232 | 0 | 232 | 0,01 |
| 01/2017 | | 53.600 | | 12.540 | GLM | 502 | 0 | 502 | 0,02 |
| 01/2017 | | 51.100 | | 12.021 | JPM | 544 | 0 | 544 | 0,02 |
| 01/2017 | | 35.100 | | 8.025 | TOR | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | | | | | | $ 53.493 | $ (35.966) | $ 17.527 | 0,70 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 2.357** | **0,09** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.496.596** | **139,34** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1.343 | $ 1.980 | 0,08 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 22 | 22 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 4 | 3 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 315 | 215 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 12.425 | 103 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 608 | 608 | 0,02 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 35 | 4 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 123 | 1 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 7 | 10 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7 | 7 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 12 | 8 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 190 | 190 | 0,01 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 4 | 4 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 15 | 11 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 183 | 183 | 0,01 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 3 | 2 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 0 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 466 | 506 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 5.233 | 44 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 424 | 625 | 0,03 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 4.536** | **0,18** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (991.789)** | **(39,52)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 2.509.343** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 107.620 und Barmittel in Höhe von USD 690 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(c) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 921.402 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(d) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 15.840 und Barmittel von USD 1.906 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.304 und Barmittel in Höhe von USD 376 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(h) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 8.840 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(i) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 100.416 | $ 3.388.154 | $ 7.206 | $ 3.495.776 |
| Finanzderivate[3] | 1.154 | (334) | 0 | 820 |
| **Summen** | **$ 101.570** | **$ 3.387.820** | **$ 7.206** | **$ 3.496.596** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.215 | $ 3.395.190 | $ 677 | $ 3.399.082 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 28.474 | 0 | 28.474 |
| Finanzderivate[3] | 497 | 11.923 | 0 | 12.420 |
| Leerverkäufe | 0 | (108.191) | 0 | (108.191) |
| **Summen** | **$ 3.712** | **$ 3.327.396** | **$ 677** | **$ 3.331.785** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(j) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class Z AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 2.659 | $ | 1.907 | AZD | $ 0 | $ (27) | $ (27) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 110 | AUD | 151 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 170 | $ | 123 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 226 | | 164 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.674 | | 1.941 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 50 | | 36 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.967 | AUD | 2.725 | GLM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2.517 | $ | 1.830 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.969 | AUD | 2.736 | NAB | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.658 | | 2.305 | SCX | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1.275 | $ | 931 | SOG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.096 | AUD | 2.894 | UAG | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1.466 | $ | 1.060 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.904 | AUD | 2.659 | AZD | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 506 | $ | 367 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.827 | AUD | 2.517 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.827 | | 2.517 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 930 | | 1.275 | SOG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 996 | | 1.379 | UAG | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 105 | $ (43) | $ 62 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class und Class S CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 33.193 | CHF | 34.080 | BOA | $ 853 | $ 0 | $ 853 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 30 | $ | 30 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 40 | | 40 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.772 | | 3.768 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 194 | CHF | 193 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 42.656 | $ | 43.152 | CBK | 539 | 0 | 539 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 40.680 | CHF | 41.524 | DUB | 802 | 0 | 802 | 0,03 |
| 01/2016 | | 631 | | 646 | FBF | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 42.320 | $ | 42.848 | JPM | 570 | 0 | 570 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 39.876 | CHF | 40.729 | JPM | 812 | 0 | 812 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 31.602 | $ | 31.897 | MSB | 331 | (5) | 326 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 7.879 | CHF | 7.771 | MSB | 0 | (115) | (115) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 67 | $ | 68 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 15 | | 15 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 48.831 | | 49.435 | UAG | 652 | 0 | 652 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 40.091 | CHF | 40.713 | UAG | 581 | 0 | 581 | 0,02 |
| 02/2016 | CHF | 88 | $ | 89 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 43.121 | CHF | 42.572 | CBK | 0 | (538) | (538) | (0,02) |
| 02/2016 | | 42.901 | | 42.320 | JPM | 0 | (570) | (570) | (0,02) |
| 02/2016 | | 31.653 | | 31.317 | MSB | 0 | (329) | (329) | (0,01) |
| 02/2016 | | 49.492 | | 48.831 | UAG | 0 | (649) | (649) | (0,02) |
| | | | | | | $ 5.156 | $ (2.207) | $ 2.949 | 0,12 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 243.064 | $ | 266.779 | BOA | $ 2.939 | $ (201) | $ 2.738 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 270.891 | € | 254.075 | BOA | 5.111 | 0 | 5.111 | 0,21 |
| 01/2016 | | 2.090 | | 1.963 | BPS | 44 | (1) | 43 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.721 | $ | 1.887 | BPS | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.937 | | 11.880 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 46.393 | | 50.816 | CBK | 428 | (8) | 420 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 6.942 | € | 6.473 | CBK | 94 | (3) | 91 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.053 | $ | 1.126 | DUB | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 168.149 | € | 158.695 | GLM | 4.241 | 0 | 4.241 | 0,17 |
| 01/2016 | | 261.324 | | 245.219 | HUS | 5.058 | 0 | 5.058 | 0,20 |
| 01/2016 | € | 235.154 | $ | 258.421 | HUS | 2.973 | 0 | 2.973 | 0,12 |
| 01/2016 | | 168.488 | | 184.118 | JPM | 1.089 | 0 | 1.089 | 0,04 |
| 01/2016 | | 761 | | 810 | NAB | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.962 | | 11.908 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 76 | € | 69 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7 | | 6 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 474 | $ | 519 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 297.944 | € | 280.447 | UAG | 6.706 | 0 | 6.706 | 0,27 |
| 01/2016 | € | 249.566 | $ | 272.568 | UAG | 1.488 | (24) | 1.464 | 0,06 |
| 02/2016 | | 2.588 | | 2.843 | BOA | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 258.571 | € | 235.154 | BOA | 0 | (2.942) | (2.942) | (0,12) |
| 02/2016 | | 258.604 | | 235.154 | HUS | 0 | (2.975) | (2.975) | (0,12) |
| 02/2016 | | 184.244 | | 168.488 | JPM | 0 | (1.086) | (1.086) | (0,04) |
| 02/2016 | € | 6 | $ | 7 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 270.592 | € | 247.552 | UAG | 0 | (1.485) | (1.485) | (0,06) |
| | | | | | | $ 30.222 | $ (8.762) | $ 21.460 | 0,86 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged), Class R GBP (Hedged) und Class S GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 160 | £ | 106 | AZD | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 46 | $ | 69 | AZD | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.880 | £ | 1.253 | BOA | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 983 | $ | 1.476 | BOA | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 57.919 | £ | 38.486 | BPS | 0 | (1.195) | (1.195) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 3.182 | $ | 4.690 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 44.942 | | 66.697 | CBK | 457 | 0 | 457 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 68.962 | £ | 45.647 | CBK | 0 | (1.683) | (1.683) | (0,07) |
| 01/2016 | | 68.387 | | 45.365 | DUB | 0 | (1.523) | (1.523) | (0,06) |
| 01/2016 | £ | 45.090 | $ | 66.917 | JPM | 460 | 0 | 460 | 0,02 |
| 01/2016 | | 44.922 | | 66.506 | MSB | 296 | 0 | 296 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 67.991 | £ | 45.097 | MSB | 0 | (1.522) | (1.522) | (0,06) |
| 01/2016 | | 145 | | 98 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 39.748 | $ | 58.826 | SCX | 242 | 0 | 242 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 213 | $ 324 | UAG | $ 10 | $ 0 | $ 10 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 66.660 | £ 44.916 | CBK | 0 | (453) | (453) | (0,02) |
| 02/2016 | 66.665 | 44.922 | JPM | 0 | (450) | (450) | (0,02) |
| 02/2016 | 66.510 | 44.922 | MSB | 0 | (295) | (295) | (0,01) |
| 02/2016 | 58.830 | 39.748 | SCX | 0 | (241) | (241) | (0,01) |
| 02/2016 | 1.272 | 853 | UAG | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | | | | $ 1.493 | $ (7.414) | $ (5.921) | (0,24) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Currency Exposure) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 3 | AUD 4 | NAB | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 4 | $ 3 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | 1 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1 | AUD 1 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD 1 | $ 1 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1 | CAD 1 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD 9 | $ 7 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 7 | CAD 9 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | DKK 9 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK 9 | $ 1 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 13 | 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 2 | DKK 13 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 2 | € 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 2 | $ 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 57 | 62 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 60 | € 57 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 6 | $ 6 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 7 | € 6 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 9 | $ 14 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 14 | £ 9 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 22 | 15 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 15 | $ 22 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 45 | 69 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 68 | £ 45 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY 92 | $ 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1 | JPY 92 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 2 | NZD 3 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD 3 | $ 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK 28 | 3 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 3 | SEK 28 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY 809 | $ 7 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 7 | JPY 809 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 4 | $ (2) | $ 2 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD 6.371 | $ 4.491 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.904 | SGD 2.682 | BOA | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD 27 | $ 19 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.904 | SGD 2.687 | BRC | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | 6.271 | 8.885 | CBK | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | 13.275 | 18.817 | DUB | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| 02/2016 | 84.155 | 118.714 | HUS | 0 | (619) | (619) | (0,03) |
| 02/2016 | 5.862 | 8.285 | JPM | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.770 | 2.504 | MSB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | 84.144 | 118.462 | SCX | 0 | (785) | (785) | (0,03) |
| 02/2016 | 15.213 | 21.524 | UAG | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (1.593) | $ (1.593) | (0,06) |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 34.600 | $ 37.761 | $ (144) | $ 0 | $ (144) | (0,01) |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,600 % | 23.11.2015 | 22.01.2016 | $ 3.784 | $ (3.786) | (0,15) |
| BOS | 0,650 % | 23.11.2015 | 04.01.2016 | 6.498 | (6.503) | (0,26) |
| BSN | 0,340 % | 13.10.2015 | 13.01.2016 | 8.344 | (8.350) | (0,33) |
| BSN | 0,430 % | 04.11.2015 | 05.01.2016 | 12.254 | (12.262) | (0,49) |
| BSN | 0,450 % | 12.11.2015 | 12.01.2016 | 145.029 | (145.120) | (5,78) |
| BSN | 0,500 % | 10.11.2015 | 12.01.2016 | 12.035 | (12.044) | (0,48) |
| IND | 0,320 % | 16.11.2015 | 11.01.2016 | 46.872 | (46.891) | (1,87) |
| IND | 0,340 % | 09.10.2015 | 11.01.2016 | 15.878 | (15.891) | (0,63) |
| IND | 0,340 % | 18.11.2015 | 11.01.2016 | 77.037 | (77.069) | (3,07) |
| IND | 0,340 % | 09.12.2015 | 11.01.2016 | 51.125 | (51.136) | (2,04) |
| IND | 0,450 % | 09.12.2015 | 05.01.2016 | 30.708 | (30.717) | (1,22) |
| IND | 0,460 % | 25.11.2015 | 25.01.2016 | 49.572 | (49.596) | (1,98) |
| IND | 0,510 % | 02.12.2015 | 13.01.2016 | 3.232 | (3.233) | (0,13) |
| MYI | (0,150 %) | 05.10.2015 | 14.01.2016 | € 74.274 | (80.653) | (3,22) |
| | | | | | $ (543.251) | (21,65) |

**(m) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GSC | 0,790 % | 02.12.2015 | 04.01.2016 | $ 6.902 | $ (6.906) | (0,28) |
| IND | (0,142 %) | 03.12.2015 | 06.01.2016 | € 132.992 | (144.479) | (5,77) |
| IND | 9,267 % | 03.12.2015 | 06.01.2016 | 18.639 | (20.403) | (0,81) |
| JML | 0,899 % | 03.12.2015 | 06.01.2016 | £ 157.526 | (232.346) | (9,26) |
| MSC | 0,375 % | 09.10.2015 | 07.01.2016 | $ 22.894 | (22.920) | (0,91) |
| TDM | 0,355 % | 09.10.2015 | 11.01.2016 | 22.997 | (23.026) | (0,91) |
| TDM | 0,624 % | 12.11.2015 | 07.01.2016 | CAD 28.828 | (20.782) | (0,83) |
| TDM | 0,629 % | 12.11.2015 | 07.01.2016 | 15.796 | (11.386) | (0,45) |
| TDM | 0,639 % | 12.11.2015 | 07.01.2016 | 7.044 | (5.076) | (0,20) |
| TDM | 0,641 % | 12.11.2015 | 07.01.2016 | 23.684 | (17.068) | (0,68) |
| | | | | | $ (504.392) | (20,10) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 8 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(n) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (2) | $ 0 | $ (2) |
| BOA | (3.269) | 4.200 | 931 |
| BPS | (965) | 240 | (725) |
| BRC | (3) | 0 | (3) |
| CBK | 5.909 | (6.860) | (951) |
| DUB | 2.812 | (10.980) | (8.168) |
| FBF | (329) | 470 | 141 |
| GLM | 1.659 | (4.750) | (3.091) |
| GST | (10) | 70 | 60 |
| HUS | 271 | (1.650) | (1.379) |
| JPM | 6.567 | (7.030) | (463) |
| MSB | 724 | (1.250) | (526) |
| MYC | 1.883 | (2.020) | (137) |
| NAB | 5 | 0 | 5 |
| NGF | (40) | 0 | (40) |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| RYL | (2.734) | 2.790 | 56 |
| SCX | (181) | 0 | (181) |
| SOG | (31) | (40) | (71) |
| TOR | 125 | 0 | 125 |
| UAG | 6.780 | (9.605) | (2.825) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(o) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 139,31 | 143,92 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,05 | 0,02 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,11) | (0,52) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,09 | 1,02 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (4,58) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 1,21 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Global Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 186.530.736 | $ 1.866.347 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 94.531 | 114.003 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 90.766 | 109.640 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 77.379 | 95.801 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 78.100 | 90.313 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 24.690 | 34.354 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 3,250 % fällig am 04.07.2042 | | 18.400 | 32.599 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 19.861 | 30.361 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.07.2015 (b) | $ | 28.060 | 28.350 |
| **France Government Bond** | | | |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 | € | 17.630 | 26.772 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.04.2015 (b) | $ | 26.508 | 26.460 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 (b) | | 23.590 | 24.372 |
| **France Government Bond** | | | |
| 3,500 % fällig am 25.04.2020 | € | 17.570 | 22.173 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b) | $ | 17.022 | 21.590 |
| **Mexico Government International Bond** | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 | MXN | 264.128 | 20.545 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | $ | 13.651 | 19.201 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b) | | 8.129 | 11.133 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 8.587 | 10.944 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 | € | 7.834 | 9.470 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 35.100 | 9.013 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 176.812.507 | $ 1.769.100 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 90.598 | 113.326 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | $ | 84.723 | 101.737 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 85.275 | 96.671 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 53.672 | 64.347 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 24.690 | 34.469 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.07.2015 (b) | $ | 33.430 | 33.567 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 29.618 | 33.451 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 3,250 % fällig am 04.07.2042 | € | 18.400 | 28.044 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.04.2015 (b) | $ | 25.692 | 25.725 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 85.015 | 24.198 |
| **Canada Government Bond** | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | CAD | 20.667 | 21.697 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b) | $ | 20.098 | 21.229 |
| **Sweden Inflation-Linked Bond** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2015 (b) | SEK | 120.000 | 17.250 |
| **Mexico Government International Bond** | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 | MXN | 239.807 | 16.270 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 10.927 | 13.645 |
| **France Government Bond** | | | |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 | € | 8.940 | 13.451 |
| **France Government Bond** | | | |
| 1,000 % fällig am 25.07.2017 | | 11.256 | 12.747 |
| **New Zealand Government Bond** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2016 | NZD | 12.000 | 12.425 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | $ | 8.754 | 12.267 |

(a) Der Global Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BANKWECHSEL** | | | | |
| **National Bank of Canada** | | | | |
| 0,829 % fällig am 26.01.2016 | CAD | 100.000 | $ 71.946 | 0,57 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,821 % fällig am 29.01.2016 | | 89.600 | 64.469 | 0,51 |
| **Toronto Dominion Bank** | | | | |
| 0,820 % fällig am 29.01.2016 | | 89.600 | 64.469 | 0,52 |
| | | | 200.884 | 1,60 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Albertson's LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 25.08.2019 | $ | 203 | 202 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2021 | | 8.709 | 8.649 | 0,07 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2020 | | 3.408 | 3.346 | 0,03 |
| **Chrysler Group LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 31.12.2018 | | 10.539 | 10.461 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 24.05.2017 | | 5.502 | 5.493 | 0,04 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 700 | 696 | 0,01 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 1.874 | 1.870 | 0,02 |
| **DaVita HealthCare Partners, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.06.2021 | | 4.695 | 4.681 | 0,04 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.10.2018 | | 19.197 | 19.165 | 0,15 |
| **Delos Finance Sarl** | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.03.2021 | | 12.861 | 12.831 | 0,10 |
| **Endo Luxembourg Finance I Co. Sarl** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.09.2022 | | 1.700 | 1.681 | 0,01 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | | 254.577 | 254.140 | 2,03 |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.06.2019 | | 405 | 304 | 0,00 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,174 % fällig am 31.03.2017 | | 900 | 900 | 0,01 |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 18.201 | 18.203 | 0,15 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 29.988 | 29.962 | 0,24 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 7,174 % fällig am 30.01.2019 | | 18.600 | 13.113 | 0,10 |
| **La Quinta Intermediate Holdings LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.04.2021 | | 1.909 | 1.865 | 0,01 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 800 | 791 | 0,01 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 3,174 % fällig am 20.12.2017 | | 11.117 | 11.061 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 20.12.2019 | | 13.224 | 13.079 | 0,10 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 14.803 | 14.456 | 0,12 |
| **OGX Petroleo Gas S.A.** | | | | |
| 13,000 % fällig am 10.04.2049 | | 1.161 | 1.189 | 0,01 |
| **Sabine Oil & Gas LLC** | | | | |
| 8,750 % fällig am 31.12.2018 (a) | | 1.800 | 45 | 0,00 |
| **Seadrill Operating LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.02.2021 | | 586 | 242 | 0,00 |
| **Sequa Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 19.06.2017 | | 1.454 | 1.011 | 0,01 |
| **Texas Competitive Electric Holdings Co. LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.11.2016 | | 2.201 | 2.190 | 0,02 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.11.2022 | | 8.067 | 8.076 | 0,06 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2020 | | 41.696 | 40.901 | 0,33 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 4.050 | 3.912 | 0,03 |
| | | | 484.515 | 3,87 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **AGFC Capital Trust I** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2067 | | 5.300 | 3.736 | 0,03 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 5.040 | $ 5.040 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 800 | 800 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 29.09.2017 | | 3.400 | 3.404 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 33.660 | 33.828 | 0,27 |
| 3,500 % fällig am 27.01.2019 | | 1.300 | 1.285 | 0,01 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 27.000 | 27.067 | 0,22 |
| 4,750 % fällig am 10.09.2018 | | 5.000 | 5.131 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 43.310 | 44.718 | 0,36 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2017 | | 25.430 | 26.733 | 0,21 |
| **Aviation Loan Trust 2013-2** | | | | |
| 2,622 % fällig am 15.09.2021 | | 9.257 | 8.575 | 0,07 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 10.800 | 11.499 | 0,09 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 200 | 215 | 0,00 |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 2.860 | 2.188 | 0,02 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 | € | 15.900 | 2.513 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 | | 7.600 | 1.129 | 0,01 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 4.800 | 4.915 | 0,04 |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | | 400 | 474 | 0,00 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | $ | 500 | 499 | 0,00 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | € | 13.000 | 13.248 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 21.000 | 1.304 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 01.08.2025 | $ | 19.400 | 19.733 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 9.200 | 9.425 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 13.05.2021 | | 9.500 | 10.391 | 0,08 |
| 5,700 % fällig am 24.01.2022 | | 2.200 | 2.484 | 0,02 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 2,010 % fällig am 21.12.2020 | MXN | 30.000 | 1.694 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 14.700 | 16.767 | 0,13 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 11.300 | 12.077 | 0,10 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 3.200 | 6.110 | 0,05 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.600 | 1.765 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 19.900 | 29.389 | 0,23 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 9.700 | 11.455 | 0,09 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.400 | 1.495 | 0,01 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 09.12.2019 | | 6.100 | 6.334 | 0,05 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 29.08.2049 | | 7.300 | 9.364 | 0,08 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 10.787 | 11.858 | 0,09 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | | 3.056 | 3.132 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | | 9.758 | 10.075 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 7.918 | 8.195 | 0,07 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,161 % fällig am 30.11.2017 | € | 3.000 | 3.265 | 0,03 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 13.500 | 17.488 | 0,14 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 5.700 | 5.882 | 0,05 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 1.500 | 1.616 | 0,01 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | | 4.865 | 6.024 | 0,05 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | £ | 1.100 | 1.770 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 200 | 323 | 0,00 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | | 200 | 291 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 8.400 | 8.616 | 0,07 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | | 2.200 | 2.376 | 0,02 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | | 5.300 | 5.255 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 5.600 | 5.427 | 0,04 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 1,570 % fällig am 14.02.2018 | JPY | 500.000 | 4.118 | 0,03 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | $ | 2.850 | 2.854 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 450 | 456 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 2.000 | 2.085 | 0,02 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.09.2020 | | 2.200 | 2.201 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | $ | 6.600 | $ 6.657 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 21.10.2045 | | 3.600 | 3.590 | 0,03 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | € | 3.200 | 4.006 | 0,03 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | $ | 2.630 | 2.526 | 0,02 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 10.000 | 10.735 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 60.185 | 65.976 | 0,53 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | $ | 4.725 | 4.796 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 6.935 | 7.134 | 0,06 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 550 | 604 | 0,01 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | | 1.300 | 1.388 | 0,01 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2022 | | 900 | 760 | 0,01 |
| **Jefferies Group LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.01.2043 | | 1.600 | 1.484 | 0,01 |
| **Jefferies LoanCore LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | | 3.800 | 3.648 | 0,03 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 5.200 | 5.681 | 0,05 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 6,850 % fällig am 15.06.2017 | | 608 | 648 | 0,01 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | € | 100 | 156 | 0,00 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 6.525 | 13.089 | 0,10 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 20.700 | 29.535 | 0,24 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 15.218 | 23.548 | 0,19 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 1.400 | 2.190 | 0,02 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2025 | $ | 9.900 | 9.854 | 0,08 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.07.2025 | | 4.400 | 4.544 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.09.2017 | | 1.700 | 1.679 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 13.280 | 12.450 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 6.752 | 6.768 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 100 | 99 | 0,00 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 3.125 | 3.297 | 0,03 |
| 8,780 % fällig am 15.09.2016 | MXN | 1.500 | 87 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 22.613 | 3.021 | 0,02 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | € | 3.935 | 3.721 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 3.233 | 3.086 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 5.335 | 5.080 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 5.240 | 5.096 | 0,04 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 83.849 | 11.241 | 0,09 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 236.955 | 33.061 | 0,26 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2019 | $ | 14.645 | 14.883 | 0,12 |
| 7,250 % fällig am 15.12.2021 | | 15.827 | 15.906 | 0,13 |
| **Preferred Term Securities XV Ltd.** | | | | |
| 1,050 % fällig am 26.09.2034 | | 18.706 | 14.403 | 0,12 |
| **Preferred Term Securities XVI Ltd.** | | | | |
| 1,092 % fällig am 23.03.2035 | | 10.000 | 5.750 | 0,05 |
| **Preferred Term Securities XVIII Ltd.** | | | | |
| 0,892 % fällig am 23.09.2035 | | 449 | 344 | 0,00 |
| **Preferred Term Securities XX Ltd.** | | | | |
| 0,962 % fällig am 22.03.2038 | | 9.689 | 5.862 | 0,05 |
| **Preferred Term Securities XXIII Ltd.** | | | | |
| 0,712 % fällig am 22.12.2036 | | 6.293 | 4.751 | 0,04 |
| **Preferred Term Securities XXIV Ltd.** | | | | |
| 0,892 % fällig am 22.03.2037 | | 9.869 | 5.329 | 0,04 |
| **Preferred Term Securities XXVI Ltd.** | | | | |
| 0,812 % fällig am 22.09.2037 | | 11.241 | 8.038 | 0,06 |
| 0,882 % fällig am 22.09.2037 | | 12.406 | 6.761 | 0,05 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.11.2025 | | 1.790 | 1.779 | 0,01 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 79.988 | 11.113 | 0,09 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-1** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | $ | 2.000 | 1.483 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-3** | | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | $ | 6.600 | $ 4.859 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | | 12.414 | 14.431 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 2.400 | 2.505 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.000 | 2.120 | 0,02 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 700 | 759 | 0,01 |
| 10,500 % fällig am 16.03.2022 | € | 200 | 242 | 0,00 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 4.593 | 3.680 | 0,03 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | $ | 28.900 | 29.474 | 0,24 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 52.900 | 56.556 | 0,45 |
| 4,950 % fällig am 07.02.2017 | $ | 11.700 | 11.837 | 0,09 |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | | 19.100 | 19.245 | 0,15 |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | | 100 | 102 | 0,00 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 18.950 | 18.747 | 0,15 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 60.600 | 61.018 | 0,49 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2020 | | 8.250 | 9.638 | 0,08 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 29.09.2049 | | 12.300 | 12.556 | 0,10 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2016 | | 200 | 203 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2017 | | 4.300 | 4.397 | 0,04 |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 91.696 | 95.135 | 0,76 |
| **Tesco Property Finance 1 PLC** | | | | |
| 7,623 % fällig am 13.07.2039 | £ | 1.771 | 2.768 | 0,02 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 6.130 | 8.518 | 0,07 |
| **Tesco Property Finance 3 PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 1.280 | 1.662 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance 4 PLC** | | | | |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 5.764 | 7.444 | 0,06 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 1.253 | 1.571 | 0,01 |
| **TIG FINCO PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 02.03.2020 | | 1.701 | 2.583 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 02.04.2020 | | 8.738 | 11.462 | 0,09 |
| **Toll Road Investors Partnership II LP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.02.2045 | $ | 22.542 | 4.734 | 0,04 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | | 13.400 | 13.639 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 27.500 | 27.844 | 0,22 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 16.000 | 16.740 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 3.750 | 4.281 | 0,03 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.600 | 2.970 | 0,02 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | $ | 2.210 | 2.192 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 28.350 | 28.377 | 0,23 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 03.04.2049 | | 500 | 474 | 0,00 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | |
| 3,035 % fällig am 21.02.2018 | € | 3.200 | 3.364 | 0,03 |
| 4,032 % fällig am 21.02.2023 | | 1.300 | 1.301 | 0,01 |
| 5,942 % fällig am 21.11.2023 | $ | 11.300 | 10.594 | 0,08 |
| 6,025 % fällig am 05.07.2022 | | 13.209 | 12.540 | 0,10 |
| 6,800 % fällig am 22.11.2025 | | 4.400 | 4.305 | 0,03 |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | | 33.034 | 33.529 | 0,27 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | | 1.100 | 1.111 | 0,01 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 | | 11.300 | 11.416 | 0,09 |
| | | | 1.390.651 | 11,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 14.05.2025 | | 828 | 819 | 0,01 |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | | 1.200 | 1.202 | 0,01 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.05.2025 | | 1.300 | 1.237 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 22.05.2024 | | 500 | 501 | 0,00 |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | € | 700 | 710 | 0,01 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.09.2016 | $ | 2.176 | $ 2.195 | 0,02 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.10.2019 (b)(c) | | 3.736 | 2.330 | 0,02 |
| **Caesars Entertainment Operating Co., Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2020 (a) | | 50.365 | 38.529 | 0,31 |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 (a) | | 51.348 | 39.281 | 0,31 |
| 11,250 % fällig am 01.06.2017 (a) | | 71.779 | 54.193 | 0,43 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 (b) | | 7.235 | 2.614 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 1.452 | 465 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 1.156 | 355 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 (b) | | 8.227 | 4.350 | 0,03 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 3.104 | 3.088 | 0,02 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 4.656 | 4.645 | 0,04 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 6.984 | 6.988 | 0,06 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 1.553 | 1.573 | 0,01 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 8.666 | 2.448 | 0,02 |
| **Continental Airlines 2001-1 Class A-1 Pass-Through Trust** | | | | |
| 6,703 % fällig am 15.06.2021 | | 1.256 | 1.307 | 0,01 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,163 % fällig am 11.08.2036 | | 1.443 | 1.405 | 0,01 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 2.212 | 2.433 | 0,02 |
| 6,943 % fällig am 10.01.2030 | | 550 | 629 | 0,00 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 13.960 | 14.012 | 0,11 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 06.12.2018 | £ | 900 | 1.421 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 1.400 | 2.200 | 0,02 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 4.850 | 7.363 | 0,06 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2020 | $ | 5.600 | 3.640 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2021 | | 3.350 | 2.119 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 15.10.2019 | | 2.400 | 1.572 | 0,01 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 3.410 | 3.420 | 0,03 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2019 | | 9.505 | 9.600 | 0,08 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 1.800 | 1.818 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 748.000 | 5.722 | 0,05 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2019 | $ | 14.260 | 10.463 | 0,08 |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | | 18.760 | 13.155 | 0,11 |
| 9,000 % fällig am 15.09.2022 | | 63.601 | 44.123 | 0,35 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 11.02.2023 | | 3.609 | 3.540 | 0,03 |
| **Intrepid Aviation Group Holdings LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2019 | | 1.150 | 949 | 0,01 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.06.2016 | | 2.400 | 2.450 | 0,02 |
| 10,000 % fällig am 01.11.2016 | | 6.890 | 7.301 | 0,06 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | | 950 | 944 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 82.400 | 90.966 | 0,73 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | $ | 6.900 | 6.710 | 0,05 |
| **OGX Austria GmbH (a)** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.04.2022 | | 5.150 | 0 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 01.06.2018 | | 24.850 | 1 | 0,00 |
| **Perstorp Holding AB** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.05.2017 | | 14.745 | 14.671 | 0,12 |
| 9,000 % fällig am 15.05.2017 (b) | € | 11.600 | 12.740 | 0,10 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | $ | 3.117 | 2.723 | 0,02 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.04.2017 | | 909 | 459 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 | | 4.719 | 1.722 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 | | 1.750 | 648 | 0,01 |
| 8,500 % fällig am 02.11.2017 | | 404 | 216 | 0,00 |
| **Priory Group No.3 PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2018 | £ | 1.224 | 1.850 | 0,01 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | $ | 750 | 651 | 0,01 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2040 | | 6.053 | 5.236 | 0,04 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 9.350 | $ 13.057 | 0,10 |
| **Sequa Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.12.2017 | $ | 1.682 | 542 | 0,00 |
| **Spanish Broadcasting System, Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 15.04.2017 | | 10.990 | 10.839 | 0,09 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 1,139 % fällig am 28.12.2028 | £ | 55 | 65 | 0,00 |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | | 2.000 | 2.742 | 0,02 |
| 5,472 % fällig am 28.12.2028 | | 6.590 | 9.859 | 0,08 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 2.400 | 3.705 | 0,03 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2022 | $ | 600 | 599 | 0,00 |
| 4,150 % fällig am 01.02.2024 | | 1.900 | 1.977 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2021 | | 1.860 | 1.973 | 0,02 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 3.738 | 4.527 | 0,04 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.06.2022 | | 900 | 959 | 0,01 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 7.965 | 11.733 | 0,09 |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 5.688 | 8.771 | 0,07 |
| **United Airlines 2014-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 11.04.2026 | $ | 873 | 894 | 0,01 |
| **United Airlines 2014-2 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.09.2026 | | 13.800 | 13.939 | 0,11 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 (b) | | 780 | 743 | 0,01 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 6.300 | 5.974 | 0,05 |
| **Virgin Australia 2013-1A Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.10.2023 | $ | 445 | 460 | 0,00 |
| **Virgin Australia 2013-1B Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 23.10.2020 | | 99 | 100 | 0,00 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | € | 1.700 | 1.779 | 0,01 |
| **Westmoreland Coal Co.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.01.2022 | $ | 7.561 | 4.688 | 0,04 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 3.583 | 3.207 | 0,03 |
| | | | 550.834 | 4,40 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AK Transneft OJSC Via TransCapitalInvest Ltd.** | | | | |
| 8,700 % fällig am 07.08.2018 | | 4.600 | 5.044 | 0,04 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | | 3.600 | 3.519 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 1.267 | 1.220 | 0,01 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 38.000 | 33.750 | 0,27 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 46.700 | 44.187 | 0,35 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | | 500 | 470 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 06.02.2028 | | 9.200 | 7.797 | 0,06 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | | 12.494 | 12.491 | 0,10 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 27.630 | 27.886 | 0,22 |
| 6,605 % fällig am 13.02.2018 | € | 2.200 | 2.515 | 0,02 |
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | $ | 8.028 | 8.019 | 0,06 |
| 8,146 % fällig am 11.04.2018 | | 3.500 | 3.780 | 0,03 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 37.494 | 42.199 | 0,34 |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 67.350 | 75.404 | 0,60 |
| **Illinois Power Generating Co.** | | | | |
| 6,300 % fällig am 01.04.2020 | | 4.060 | 2.456 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 15.04.2018 | | 3.900 | 2.633 | 0,02 |
| 7,950 % fällig am 01.06.2032 | | 3.200 | 1.872 | 0,02 |
| **Linn Energy LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.02.2021 | | 2.500 | 375 | 0,00 |
| 8,625 % fällig am 15.04.2020 | | 3.810 | 672 | 0,01 |
| 12,000 % fällig am 15.12.2020 | | 1.695 | 864 | 0,01 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 6.174 | 6.035 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 1.930 | 1.906 | 0,02 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 8.670 | 6.611 | 0,05 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 12.484 | 11.470 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2019 | | 1.260 | 961 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 4.701 | 4.360 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 01.04.2019 | € | 2.409 | 1.925 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | $ | 4.978 | $ 3.547 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 6.773 | 6.350 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 14.01.2021 | € | 300 | 218 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | $ | 1.332 | 1.328 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 18.733 | 12.411 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 13.574 | 10.214 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 25.020 | 18.702 | 0,15 |
| 5,625 % fällig am 20.05.2043 | | 595 | 364 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 21.612 | 17.019 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | | 3.500 | 3.124 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 07.03.2022 | € | 800 | 621 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | $ | 215 | 155 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 900 | 866 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | | 1.800 | 1.643 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 27.01.2041 | $ | 21.931 | 14.145 | 0,11 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 34.900 | 22.772 | 0,18 |
| 6,875 % fällig am 20.01.2040 | | 4.356 | 2.853 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | | 13.300 | 11.804 | 0,09 |
| 8,375 % fällig am 10.12.2018 | | 920 | 849 | 0,01 |
| **Sierra Hamilton LLC** | | | | |
| 12,250 % fällig am 15.12.2018 | | 2.200 | 1.078 | 0,01 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 660 | 660 | 0,01 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 5.526 | 4.013 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 160 | 121 | 0,00 |
| **Tokyo Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,060 % fällig am 31.08.2016 | JPY | 20.000 | 168 | 0,00 |
| 2,080 % fällig am 31.05.2016 | | 50.000 | 418 | 0,00 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | $ | 11.500 | 12.663 | 0,10 |
| | | | 458.527 | 3,66 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 2.400.012 | 19,17 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Oleo e Gas Participacoes S.A.** | | | | |
| 10,000 % fällig am 11.04.2015 (I) | BRL | 6.484 | 1.341 | 0,01 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cook County, Illinois, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | $ | 2.765 | 2.887 | 0,02 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 500 | 548 | 0,00 |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | | 3.160 | 3.342 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | | 5.600 | 5.673 | 0,05 |
| | | | 12.450 | 0,10 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,238 % fällig am 27.12.2022 | | 194.776 | 2.464 | 0,02 |
| 0,626 % fällig am 25.08.2022 | | 18.950 | 593 | 0,01 |
| 2,333 % fällig am 25.01.2022 | | 6.200 | 592 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.02.2028 (d) | | 33.391 | 2.931 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 25.06.2042 - 01.01.2046 (d) | | 243.253 | 243.469 | 1,94 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2040 - 01.01.2046 | | 184.007 | 190.077 | 1,52 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2019 - 01.11.2045 | | 95.998 | 101.698 | 0,81 |
| 4,228 % fällig am 25.03.2035 (d) | | 638 | 71 | 0,00 |
| 4,422 % fällig am 25.05.2025 | | 1.350 | 1.284 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2040 - 25.12.2042 (d) | | 14.497 | 14.893 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2021 - 01.07.2040 | | 85 | 93 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2032 - 25.05.2038 | | 87 | 104 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.06.2022 - 01.05.2038 | | 11 | 15 | 0,00 |
| 6,228 % fällig am 25.04.2037 (d) | | 1.638 | 174 | 0,00 |
| 6,248 % fällig am 25.10.2017 | | 33.631 | 1.159 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2017 - 01.10.2037 | | 7 | 11 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.04.2029 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 7,142 % fällig am 25.08.2033 | | 433 | 469 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.01.2023 - 01.10.2030 | | 6 | 7 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.12.2022 - 01.03.2030 | $ | 3 | $ 3 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 01.11.2024 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 12,235 % fällig am 25.05.2041 | | 124 | 142 | 0,00 |
| 37,070 % fällig am 25.07.2037 | | 39 | 74 | 0,00 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.09.2027 - 15.12.2027 (d) | | 33.729 | 3.082 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.12.2042 (d) | | 13.238 | 2.098 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2025 - 15.01.2043 (d) | | 16.346 | 2.864 | 0,02 |
| 3,672 % fällig am 25.05.2025 | | 1.500 | 1.389 | 0,01 |
| 3,722 % fällig am 25.10.2027 | | 800 | 761 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2018 - 01.05.2041 (d) | | 606 | 61 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2033 - 01.04.2036 | | 1 | 2 | 0,00 |
| 5,870 % fällig am 15.01.2042 (d) | | 1.145 | 161 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2033 - 01.09.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,420 % fällig am 15.03.2037 (d) | | 349 | 53 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.11.2035 - 01.09.2038 | | 6 | 8 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.09.2028 - 01.06.2037 | | 24 | 27 | 0,00 |
| 7,713 % fällig am 15.10.2033 | | 935 | 1.062 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.07.2030 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 9,239 % fällig am 15.01.2041 | | 908 | 1.026 | 0,01 |
| 9,312 % fällig am 15.09.2041 | | 13 | 13 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,518 % fällig am 16.05.2050 | | 16.708 | 403 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2043 (d) | | 8.071 | 867 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2033 | | 1 | 2 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2038 - 20.08.2041 | | 69 | 72 | 0,00 |
| 5,806 % fällig am 16.01.2043 (d) | | 7.097 | 771 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 20.10.2038 | | 0 | 1 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2023 - 15.09.2037 | | 24 | 30 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 15.07.2023 - 15.05.2038 | | 15 | 17 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2023 - 15.03.2037 | | 5 | 7 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2024 - 15.05.2032 | | 1 | 2 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 15.07.2021 - 15.11.2024 | | 1 | 2 | 0,00 |
| 8,696 % fällig am 20.12.2040 | | 5.000 | 5.896 | 0,05 |
| 9,000 % fällig am 15.11.2019 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 9,500 % fällig am 15.03.2020 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 9,513 % fällig am 20.12.2040 | | 452 | 500 | 0,00 |
| 21,868 % fällig am 20.04.2037 | | 33 | 52 | 0,00 |
| | | | 581.558 | 4,64 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (f) | | 7.516 | 7.425 | 0,06 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 763 | 729 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | | 559 | 563 | 0,00 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | | 50.501 | 44.157 | 0,35 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (f) | | 220.858 | 251.342 | 2,01 |
| **US Treasury Bills** | | | | |
| 0,561 % fällig am 30.06.2016 (g) | | 14.373 | 14.339 | 0,12 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 (f) | | 395.796 | 390.678 | 3,12 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.11.2020 | | 129.000 | 128.247 | 1,02 |
| 1,750 % fällig am 15.05.2023 (f) | | 13.747 | 13.396 | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 200 | 195 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 431.330 | 430.412 | 3,44 |
| | | | 1.281.483 | 10,24 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **7 WTC Depositor LLC Trust** | | | | |
| 4,082 % fällig am 13.03.2031 | | 1.499 | 1.528 | 0,01 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.02.2037 | | 4.544 | 4.364 | 0,04 |
| 0,742 % fällig am 25.12.2035 | | 2.878 | 2.745 | 0,02 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 10.423 | 3.865 | 0,03 |
| 0,542 % fällig am 25.12.2036 | $ | 7.946 | $ 4.881 | 0,04 |
| 0,577 % fällig am 25.08.2036 | | 18.785 | 15.760 | 0,13 |
| 0,662 % fällig am 25.04.2036 | | 8.823 | 6.062 | 0,05 |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | | 9.939 | 8.535 | 0,07 |
| 1,082 % fällig am 25.11.2035 | | 16.600 | 14.259 | 0,11 |
| 1,112 % fällig am 25.05.2035 | | 2.422 | 2.072 | 0,02 |
| 1,202 % fällig am 25.07.2035 | | 1.259 | 1.241 | 0,01 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2034 | | 6.956 | 6.292 | 0,05 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 | | 16.878 | 10.321 | 0,08 |
| 0,682 % fällig am 25.01.2036 | | 772 | 641 | 0,01 |
| 0,692 % fällig am 25.02.2036 | | 657 | 549 | 0,00 |
| 1,572 % fällig am 25.01.2035 (a) | | 9.806 | 8.213 | 0,07 |
| 1,572 % fällig am 25.03.2035 | | 5.816 | 5.025 | 0,04 |
| 2,628 % fällig am 25.09.2035 | | 416 | 322 | 0,00 |
| 2,746 % fällig am 25.08.2035 | | 1.729 | 1.517 | 0,01 |
| 2,843 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 514 | 458 | 0,00 |
| 2,909 % fällig am 25.04.2035 | | 40 | 40 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2035 | | 9.742 | 9.094 | 0,07 |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | | 666 | 577 | 0,00 |
| **ALESCO Preferred Funding XI Ltd.** | | | | |
| 1,043 % fällig am 23.12.2036 | | 5.000 | 2.875 | 0,02 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.06.2036 | | 4.949 | 4.349 | 0,03 |
| 0,562 % fällig am 25.08.2037 | | 29.092 | 25.101 | 0,20 |
| 0,592 % fällig am 25.06.2046 | | 9.690 | 9.981 | 0,08 |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | | 3.614 | 2.745 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.07.2046 | | 4.050 | 3.413 | 0,03 |
| 0,643 % fällig am 20.07.2035 | | 5.920 | 5.114 | 0,04 |
| 0,652 % fällig am 25.08.2037 | | 14.106 | 12.240 | 0,10 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2035 | | 3.980 | 3.149 | 0,03 |
| 0,682 % fällig am 20.09.2046 | | 7.874 | 3.333 | 0,03 |
| 0,692 % fällig am 25.01.2036 | | 2.497 | 2.244 | 0,02 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2037 | | 14.282 | 11.199 | 0,09 |
| 0,702 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 9.383 | 6.605 | 0,05 |
| 0,722 % fällig am 25.08.2035 (a) | | 1.024 | 808 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 2.679 | 1.214 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.12.2035 | | 4.092 | 3.395 | 0,03 |
| 0,732 % fällig am 25.08.2035 (a) | | 6.080 | 4.907 | 0,04 |
| 0,733 % fällig am 20.11.2035 | | 5.061 | 4.057 | 0,03 |
| 0,762 % fällig am 25.09.2035 | | 1.647 | 1.183 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 5.061 | 3.067 | 0,02 |
| 0,772 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 4.289 | 3.013 | 0,02 |
| 0,792 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 1.748 | 979 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 7.765 | 3.345 | 0,03 |
| 0,822 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 3.820 | 1.912 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 25.05.2035 (a) | | 11.658 | 9.542 | 0,08 |
| 0,922 % fällig am 25.09.2036 | | 269 | 195 | 0,00 |
| 0,922 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 4.605 | 2.864 | 0,02 |
| 1,002 % fällig am 25.05.2034 | | 620 | 604 | 0,01 |
| 1,172 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 273 | 208 | 0,00 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.666 | 1.056 | 0,01 |
| 1,522 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 253 | 201 | 0,00 |
| 1,567 % fällig am 20.07.2035 (a) | | 470 | 393 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.08.2035 | | 3.379 | 3.064 | 0,02 |
| 2,592 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 3.197 | 2.914 | 0,02 |
| 2,679 % fällig am 25.09.2034 (a) | | 10.759 | 9.731 | 0,08 |
| 2,976 % fällig am 25.09.2034 | | 441 | 428 | 0,00 |
| 3,007 % fällig am 25.12.2034 | | 329 | 327 | 0,00 |
| 4,810 % fällig am 25.07.2021 (a) | | 198 | 197 | 0,00 |
| 5,272 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 1.228 | 948 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 (a) | | 2.207 | 1.917 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 3.695 | 3.497 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 13.241 | 12.851 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 | | 11.557 | 10.841 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 1.274 | 1.077 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 11.598 | 9.297 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 2.897 | 2.602 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 (a) | | 489 | 482 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 7.432 | 7.051 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 10.401 | 8.974 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 124 | 107 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 8.275 | 7.816 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 1.432 | 1.306 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.185 | 747 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 3.570 | 3.249 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 2.050 | 1.808 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 11.013 | 8.935 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 4.263 | 3.574 | 0,03 |
| 6,178 % fällig am 25.04.2035 (d) | | 1.220 | 45 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 768 | 648 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 12.622 | 9.937 | 0,08 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,528 % fällig am 25.10.2037 (a)(d) | $ | 3.162 | $ 939 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 2.140 | 1.477 | 0,01 |
| **Alternative Loan Trust Resecuritization** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 422 | 235 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 0,957 % fällig am 25.02.2047 | | 34.145 | 20.601 | 0,16 |
| 2,732 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 6.222 | 5.501 | 0,04 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 0,387 % fällig am 25.05.2047 | | 4.024 | 2.819 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.12.2046 | | 4.599 | 3.819 | 0,03 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.10.2036 | | 11.991 | 4.775 | 0,04 |
| 0,582 % fällig am 25.10.2036 | | 9.246 | 3.717 | 0,03 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.01.2036 | | 6.060 | 5.693 | 0,05 |
| 0,892 % fällig am 25.01.2036 | | 9.008 | 7.546 | 0,06 |
| 0,932 % fällig am 25.05.2035 | | 14.000 | 12.005 | 0,10 |
| 1,217 % fällig am 25.03.2035 | | 11.500 | 10.166 | 0,08 |
| 3,272 % fällig am 25.07.2034 | | 4.000 | 3.721 | 0,03 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.09.2036 | | 19.874 | 7.779 | 0,06 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | | 14.803 | 5.354 | 0,04 |
| 0,597 % fällig am 25.04.2036 | | 2.603 | 1.492 | 0,01 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | | 15.264 | 14.560 | 0,12 |
| 0,862 % fällig am 25.11.2035 | | 22.500 | 17.347 | 0,14 |
| 0,932 % fällig am 25.10.2035 | | 4.750 | 2.945 | 0,02 |
| 1,547 % fällig am 25.11.2034 | | 3.569 | 2.955 | 0,02 |
| 2,597 % fällig am 25.02.2034 | | 2.338 | 2.147 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | | 627 | 519 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.03.2035 | | 11.512 | 9.249 | 0,07 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.03.2036 | | 11.020 | 10.438 | 0,08 |
| **AyT Hipotecario IV Fondo de Titulizacion Hipotecaria** | | | | |
| 0,135 % fällig am 13.06.2033 | € | 1.618 | 1.725 | 0,01 |
| **AyT Hipotecario Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,112 % fällig am 15.09.2035 | | 1.125 | 1.200 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust (a)** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.01.2037 | $ | 5.160 | 3.266 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 788 | 721 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 1.265 | 960 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 | | 5.476 | 4.535 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 | | 10.110 | 8.992 | 0,07 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,451 % fällig am 15.01.2049 | | 8.339 | 8.559 | 0,07 |
| 5,568 % fällig am 10.04.2049 | | 15.948 | 16.425 | 0,13 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 1.865 | 1.218 | 0,01 |
| 0,522 % fällig am 25.04.2037 | | 11.506 | 8.431 | 0,07 |
| 0,592 % fällig am 20.10.2046 (a) | | 133 | 100 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 20.04.2047 (a) | | 3.054 | 2.415 | 0,02 |
| 0,652 % fällig am 20.05.2035 | | 6.398 | 5.943 | 0,05 |
| 0,702 % fällig am 25.07.2037 | | 330 | 283 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 20.05.2047 | | 1.830 | 1.519 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 3.621 | 2.675 | 0,02 |
| 2,651 % fällig am 20.07.2047 (a) | | 5.058 | 4.153 | 0,03 |
| 2,714 % fällig am 20.07.2036 | | 868 | 853 | 0,01 |
| 2,794 % fällig am 20.11.2035 (a) | | 1.404 | 1.214 | 0,01 |
| 2,814 % fällig am 20.05.2036 (a) | | 2.282 | 2.167 | 0,02 |
| 2,843 % fällig am 20.02.2036 (a) | | 334 | 284 | 0,00 |
| 2,858 % fällig am 20.09.2035 (a) | | 5.276 | 4.573 | 0,04 |
| 2,877 % fällig am 20.01.2047 (a) | | 682 | 560 | 0,00 |
| 3,007 % fällig am 20.01.2047 (a) | | 6.833 | 5.796 | 0,05 |
| 3,035 % fällig am 20.11.2034 | | 204 | 197 | 0,00 |
| 4,269 % fällig am 20.09.2037 (a) | | 369 | 301 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 468 | 493 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | | 10 | 11 | 0,00 |
| 5,846 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 704 | 591 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 10.372 | 9.128 | 0,07 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 3.578 | 2.835 | 0,02 |
| 2,496 % fällig am 25.02.2034 | | 131 | 127 | 0,00 |
| 2,732 % fällig am 25.09.2035 (a) | | 2.192 | 1.775 | 0,01 |
| 2,911 % fällig am 20.10.2046 (a) | | 2.653 | 2.156 | 0,02 |
| 2,972 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 534 | 410 | 0,00 |
| 3,088 % fällig am 20.11.2046 (a) | $ | 1.231 | $ 1.023 | 0,01 |
| 3,268 % fällig am 25.11.2034 | | 2.605 | 2.473 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 (a) | | 100 | 94 | 0,00 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,334 % fällig am 16.12.2043 | | 10.175 | 10.395 | 0,08 |
| **Bancaja 6 Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | |
| 0,158 % fällig am 20.02.2036 | € | 4.082 | 4.297 | 0,03 |
| **Bank of America-First Union NB Commercial Mortgage** | | | | |
| 6,875 % fällig am 11.04.2037 | $ | 635 | 662 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 11.04.2037 | | 660 | 692 | 0,01 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 25.04.2036 | | 2.000 | 1.799 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 0,381 % fällig am 26.06.2046 | | 6.935 | 5.730 | 0,05 |
| 0,391 % fällig am 26.09.2035 | | 4.303 | 3.933 | 0,03 |
| 0,391 % fällig am 26.01.2037 | | 18.841 | 12.970 | 0,10 |
| 0,397 % fällig am 26.12.2046 | | 600 | 601 | 0,01 |
| 0,407 % fällig am 26.07.2036 | | 5.342 | 5.098 | 0,04 |
| 0,431 % fällig am 26.07.2046 | | 12.701 | 11.744 | 0,09 |
| 0,474 % fällig am 26.05.2047 | | 3.552 | 3.446 | 0,03 |
| 0,612 % fällig am 25.10.2036 | | 396 | 313 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.04.2037 | | 366 | 320 | 0,00 |
| 1,072 % fällig am 25.09.2047 | | 4.751 | 4.088 | 0,03 |
| 1,083 % fällig am 26.11.2046 | | 9.290 | 8.969 | 0,07 |
| 2,147 % fällig am 27.01.2037 | | 9.545 | 9.264 | 0,07 |
| 2,450 % fällig am 26.03.2037 | | 5.241 | 3.898 | 0,03 |
| 2,660 % fällig am 26.08.2036 | | 13.831 | 11.588 | 0,09 |
| 2,738 % fällig am 26.07.2036 | | 2.431 | 2.187 | 0,02 |
| 2,897 % fällig am 26.07.2036 | | 5.122 | 5.132 | 0,04 |
| 2,932 % fällig am 28.09.2036 | | 1.252 | 1.248 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 26.04.2037 | | 2.359 | 2.385 | 0,02 |
| 4,408 % fällig am 26.07.2037 | | 3.208 | 2.589 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 26.02.2036 | | 5.212 | 3.773 | 0,03 |
| 6,050 % fällig am 26.05.2036 | | 6.324 | 5.543 | 0,04 |
| 9,035 % fällig am 26.08.2037 | | 15.302 | 10.703 | 0,09 |
| **BCC Mortgages PLC** | | | | |
| 0,047 % fällig am 12.03.2038 | € | 13.975 | 14.944 | 0,12 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,599 % fällig am 25.06.2035 (a) | $ | 2.783 | 2.478 | 0,02 |
| 2,727 % fällig am 25.12.2046 (a) | | 24.418 | 21.137 | 0,17 |
| 2,746 % fällig am 25.06.2035 (a) | | 156 | 146 | 0,00 |
| 2,758 % fällig am 25.05.2047 (a) | | 579 | 495 | 0,00 |
| 2,770 % fällig am 25.03.2035 | | 640 | 620 | 0,01 |
| 2,811 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 1.144 | 991 | 0,01 |
| 2,833 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 7.021 | 5.776 | 0,05 |
| 2,842 % fällig am 25.10.2035 | | 4.474 | 4.455 | 0,04 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 58.737 | 47.365 | 0,38 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2035 | | 714 | 692 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 5.629 | 4.443 | 0,04 |
| 0,902 % fällig am 25.02.2036 | | 1.690 | 1.398 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 2.884 | 2.302 | 0,02 |
| 0,962 % fällig am 25.10.2035 | | 477 | 425 | 0,00 |
| 1,062 % fällig am 25.04.2034 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,267 % fällig am 25.10.2033 | | 13 | 12 | 0,00 |
| 2,560 % fällig am 25.09.2034 | | 1.632 | 1.555 | 0,01 |
| 2,698 % fällig am 25.09.2035 (a) | | 12.667 | 9.918 | 0,08 |
| 2,702 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 4.388 | 3.183 | 0,03 |
| 2,753 % fällig am 25.01.2047 | | 230 | 166 | 0,00 |
| 2,862 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 4.475 | 3.432 | 0,03 |
| 2,956 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 4.521 | 3.400 | 0,03 |
| 3,151 % fällig am 25.08.2046 (a) | | 2.787 | 2.113 | 0,02 |
| 4,813 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 612 | 508 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 4.733 | 3.531 | 0,03 |
| 0,692 % fällig am 25.06.2036 | | 4.744 | 4.082 | 0,03 |
| 0,782 % fällig am 25.04.2036 | | 8.051 | 7.140 | 0,06 |
| 0,842 % fällig am 25.12.2035 | | 6.300 | 5.422 | 0,04 |
| 0,922 % fällig am 25.12.2035 | | 7.700 | 7.076 | 0,06 |
| 1,072 % fällig am 25.08.2035 | | 6.075 | 5.778 | 0,05 |
| 1,122 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 5.453 | 4.714 | 0,04 |
| 3,041 % fällig am 25.10.2036 | | 124 | 120 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2035 | | 5.885 | 5.550 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 (a) | | 5.686 | 5.652 | 0,05 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,547 % fällig am 25.02.2035 | | 1.706 | 1.544 | 0,01 |
| 3,024 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 221 | 42 | 0,00 |
| 3,572 % fällig am 25.11.2039 | | 1.897 | 1.642 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 1.702 | 1.330 | 0,01 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,761 % fällig am 13.02.2042 | | 1.000 | 1.010 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.12.2046 | $ | 8.968 | $ 7.104 | 0,06 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2037 | | 6.010 | 5.159 | 0,04 |
| 0,612 % fällig am 25.01.2037 | | 6.170 | 4.815 | 0,04 |
| 0,622 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 18.910 | 14.717 | 0,12 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | | 6.177 | 4.571 | 0,04 |
| 2,693 % fällig am 26.01.2036 | | 7.539 | 6.231 | 0,05 |
| **Berica ABS Srl** | | | | |
| 0,191 % fällig am 30.11.2051 | € | 3.972 | 4.298 | 0,03 |
| **Blackstone CQP Holdco LP** | | | | |
| 2,324 % fällig am 19.03.2019 | $ | 55.110 | 54.966 | 0,44 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.07.2037 | | 10.720 | 10.046 | 0,08 |
| **Business Mortgage Finance 6 PLC** | | | | |
| 0,299 % fällig am 15.08.2040 | € | 1.946 | 2.037 | 0,02 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 0,933 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 43.105 | 30.637 | 0,24 |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | | 115.875 | 82.856 | 0,66 |
| 1,133 % fällig am 01.08.2020 | | 39.225 | 28.038 | 0,22 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.02.2037 | $ | 5.300 | 3.809 | 0,03 |
| **Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.10 PLC** | | | | |
| 0,192 % fällig am 10.04.2048 | € | 9.241 | 9.287 | 0,07 |
| **Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.11 PLC** | | | | |
| 0,135 % fällig am 14.12.2048 | | 32.283 | 33.083 | 0,26 |
| 0,845 % fällig am 14.12.2048 | £ | 3.529 | 4.761 | 0,04 |
| **Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.12 Ltd.** | | | | |
| 0,067 % fällig am 18.03.2049 | € | 13.766 | 13.819 | 0,11 |
| **Celtic Residential Irish Mortgage Securitisation No.9 PLC** | | | | |
| 0,054 % fällig am 13.11.2047 | | 4.350 | 4.481 | 0,04 |
| **Chase Funding Trust** | | | | |
| 1,172 % fällig am 25.09.2033 | $ | 1.987 | 1.835 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 2,466 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 4.501 | 4.225 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 1.388 | 1.300 | 0,01 |
| 2,701 % fällig am 25.07.2037 | | 217 | 178 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.05.2035 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 14.399 | 14.538 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 1.973 | 1.678 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 5.391 | 4.523 | 0,04 |
| **Chaseflex Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.07.2037 | | 7.107 | 5.806 | 0,05 |
| **ChaseFlex Trust (a)** | | | | |
| 0,752 % fällig am 25.08.2037 | | 1.803 | 1.245 | 0,01 |
| 0,882 % fällig am 25.07.2037 | | 2.519 | 1.372 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 | | 4.156 | 3.679 | 0,03 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 0,537 % fällig am 25.10.2034 | | 609 | 564 | 0,00 |
| 0,561 % fällig am 25.10.2034 | | 2.345 | 2.172 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.01.2036 | | 1.565 | 1.429 | 0,01 |
| 0,581 % fällig am 25.03.2035 | | 879 | 797 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.01.2036 | | 4.270 | 3.929 | 0,03 |
| 0,622 % fällig am 25.10.2036 | | 3.381 | 2.965 | 0,02 |
| 0,652 % fällig am 25.10.2035 | | 3.308 | 3.073 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2035 | | 4.515 | 4.076 | 0,03 |
| 0,702 % fällig am 25.01.2035 | | 3.591 | 3.263 | 0,03 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2035 | | 1.785 | 1.649 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.08.2035 | | 750 | 682 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.05.2035 | | 1.494 | 1.373 | 0,01 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,872 % fällig am 25.10.2037 (a) | | 23.612 | 22.170 | 0,18 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,095 % fällig am 10.03.2047 | | 25.416 | 464 | 0,00 |
| 5,811 % fällig am 15.03.2049 | | 20.580 | 20.670 | 0,17 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,136 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 14.332 | 13.713 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,427 % fällig am 25.10.2034 | | 8.395 | 6.380 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.05.2037 | | 1.343 | 960 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.12.2036 | | 19.990 | 18.242 | 0,15 |
| 0,572 % fällig am 25.12.2036 | | 1.689 | 969 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,632 % fällig am 25.12.2036 | $ | 3.000 | $ 2.221 | 0,02 |
| 0,872 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 10.465 | 8.111 | 0,06 |
| 2,204 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 2.034 | 1.532 | 0,01 |
| 2,263 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 14.718 | 11.216 | 0,09 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 444 | 402 | 0,00 |
| 2,626 % fällig am 25.05.2035 | | 282 | 267 | 0,00 |
| 2,630 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 2.623 | 2.521 | 0,02 |
| 2,686 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 1.304 | 1.137 | 0,01 |
| 2,706 % fällig am 25.08.2035 (a) | | 4.453 | 3.325 | 0,03 |
| 2,923 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 8.567 | 7.169 | 0,06 |
| 2,935 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 1.961 | 1.747 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 5.688 | 5.808 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 7.925 | 6.796 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 3.600 | 2.987 | 0,02 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust (a)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 1.033 | 899 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 1.667 | 1.456 | 0,01 |
| **COMM Mortgage Trust** | | | | |
| 5,514 % fällig am 10.06.2044 | | 3.000 | 2.992 | 0,02 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,151 % fällig am 10.04.2047 | | 58.900 | 776 | 0,01 |
| 1,402 % fällig am 10.08.2046 | | 34.753 | 2.094 | 0,02 |
| 1,828 % fällig am 15.08.2045 | | 79.545 | 6.855 | 0,05 |
| 5,543 % fällig am 11.12.2049 | | 10.583 | 10.811 | 0,09 |
| **Conseco Finance Securitizations Corp.** | | | | |
| 6,600 % fällig am 01.02.2033 | | 301 | 314 | 0,00 |
| 7,770 % fällig am 01.09.2031 | | 2.694 | 2.987 | 0,02 |
| **Conseco Financial Corp.** | | | | |
| 7,060 % fällig am 01.02.2031 | | 4.538 | 4.699 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 01.03.2030 | | 27.435 | 22.421 | 0,18 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust (a)** | | | | |
| 2,729 % fällig am 25.08.2034 | | 2.772 | 2.574 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 6.559 | 5.929 | 0,05 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 | | 7.442 | 7.147 | 0,06 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | | 5.269 | 4.916 | 0,04 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2047 | | 46.262 | 42.403 | 0,34 |
| 0,642 % fällig am 25.06.2037 | | 37.394 | 26.621 | 0,21 |
| 0,702 % fällig am 25.09.2036 | | 3.600 | 3.253 | 0,03 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2036 | | 7.920 | 7.077 | 0,06 |
| 0,722 % fällig am 25.06.2036 | | 1.300 | 1.170 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.03.2047 (a) | | 935 | 696 | 0,01 |
| 0,892 % fällig am 25.02.2036 | | 10.000 | 9.000 | 0,07 |
| 0,902 % fällig am 25.05.2036 | | 13.300 | 9.511 | 0,08 |
| 0,942 % fällig am 25.01.2036 | | 5.000 | 4.560 | 0,04 |
| 1,132 % fällig am 25.07.2035 | | 7.000 | 5.432 | 0,04 |
| 1,172 % fällig am 25.05.2034 | | 5.670 | 5.428 | 0,04 |
| 1,277 % fällig am 25.05.2036 | | 4.000 | 3.436 | 0,03 |
| 1,422 % fällig am 25.08.2047 | | 6.328 | 5.904 | 0,05 |
| 1,517 % fällig am 25.12.2034 | | 10.000 | 9.375 | 0,08 |
| 1,922 % fällig am 25.10.2034 | | 1.416 | 1.132 | 0,01 |
| 4,778 % fällig am 25.09.2046 (a) | | 13.760 | 12.376 | 0,10 |
| 4,874 % fällig am 25.04.2036 | | 3.888 | 3.485 | 0,03 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | | 3.617 | 2.930 | 0,02 |
| 5,049 % fällig am 25.10.2046 (a) | | 8.345 | 7.926 | 0,06 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 | | 2.741 | 2.541 | 0,02 |
| 0,682 % fällig am 25.09.2046 | | 29.930 | 19.911 | 0,16 |
| 0,902 % fällig am 25.10.2035 | | 7.781 | 7.780 | 0,06 |
| 1,002 % fällig am 25.04.2035 | | 2.000 | 1.973 | 0,02 |
| 1,002 % fällig am 25.11.2035 | | 2.549 | 2.333 | 0,02 |
| 1,142 % fällig am 25.07.2034 | | 4.081 | 3.796 | 0,03 |
| 1,847 % fällig am 25.06.2034 | | 865 | 778 | 0,01 |
| 4,896 % fällig am 25.10.2046 (a) | | 2.682 | 2.674 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,642 % fällig am 25.05.2035 | | 236 | 177 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 25.03.2036 | | 2.055 | 1.746 | 0,01 |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | | 704 | 591 | 0,00 |
| 0,752 % fällig am 25.02.2035 | | 97 | 86 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.03.2035 | | 440 | 380 | 0,00 |
| 1,182 % fällig am 25.09.2034 | | 582 | 542 | 0,00 |
| 2,555 % fällig am 20.10.2034 | | 596 | 536 | 0,00 |
| 2,559 % fällig am 20.09.2036 (a) | | 8.088 | 7.232 | 0,06 |
| 2,565 % fällig am 20.06.2036 | | 8.588 | 7.317 | 0,06 |
| 2,591 % fällig am 20.12.2035 | | 416 | 374 | 0,00 |
| 2,596 % fällig am 20.04.2035 | | 489 | 443 | 0,00 |
| 2,602 % fällig am 20.02.2036 (a) | | 5.860 | 5.156 | 0,04 |
| 2,616 % fällig am 20.07.2034 | | 584 | 541 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 20.02.2036 | | 12.546 | 10.820 | 0,09 |
| 2,632 % fällig am 20.10.2034 | | 1.895 | 1.648 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 25.01.2036 (a) | $ | 1.552 | $ 1.357 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 20.09.2035 | | 122 | 108 | 0,00 |
| 2,723 % fällig am 20.02.2036 | | 1.645 | 1.404 | 0,01 |
| 2,741 % fällig am 20.10.2034 | | 1.174 | 1.046 | 0,01 |
| 2,760 % fällig am 25.11.2037 | | 9.456 | 8.470 | 0,07 |
| 2,815 % fällig am 20.12.2035 | | 1.175 | 1.033 | 0,01 |
| 3,283 % fällig am 20.01.2035 | | 340 | 334 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | | 23 | 23 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 4.754 | 4.473 | 0,04 |
| 5,850 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 771 | 709 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 146 | 140 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 2.975 | 2.816 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 18 | 16 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 2.883 | 2.488 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 1.388 | 1.267 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,405 % fällig am 25.03.2033 | | 363 | 354 | 0,00 |
| 3,568 % fällig am 25.10.2033 | | 87 | 85 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 2.754 | 2.548 | 0,02 |
| 5,557 % fällig am 25.07.2035 | | 10.033 | 10.063 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 6.033 | 2.712 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | | |
| 2,380 % fällig am 27.07.2037 | | 2.071 | 1.642 | 0,01 |
| 5,695 % fällig am 16.04.2049 | | 11.880 | 12.377 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (a) | | 5.572 | 4.938 | 0,04 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.09.2037 | | 1.273 | 1.144 | 0,01 |
| 2,655 % fällig am 27.10.2036 | | 210 | 206 | 0,00 |
| 4,303 % fällig am 27.01.2036 | | 26.690 | 25.708 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 27.08.2036 | | 1.864 | 1.983 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust (a)** | | | | |
| 5,942 % fällig am 25.02.2037 | | 1.577 | 879 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2021 | | 186 | 181 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 0,428 % fällig am 27.02.2036 | | 5.186 | 4.962 | 0,04 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 0,992 % fällig am 25.07.2036 | | 3.200 | 2.964 | 0,02 |
| 3,797 % fällig am 25.01.2033 | | 898 | 841 | 0,01 |
| 6,075 % fällig am 25.12.2037 | | 5.000 | 5.148 | 0,04 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.11.2036 | | 773 | 431 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | | 1.079 | 606 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.07.2036 | | 3.231 | 2.332 | 0,02 |
| 4,002 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 6.026 | 3.226 | 0,03 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,898 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 1.243 | 692 | 0,01 |
| **CWABS Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,427 % fällig am 25.01.2035 | | 489 | 490 | 0,00 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | | |
| 1,127 % fällig am 10.11.2046 | | 33.970 | 758 | 0,01 |
| 1,368 % fällig am 10.07.2044 | | 20.943 | 740 | 0,01 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | | |
| 0,769 % fällig am 27.01.2020 | £ | 15.260 | 21.311 | 0,17 |
| **Deco 9-Pan Europe 3 PLC** | | | | |
| 0,139 % fällig am 27.07.2017 | € | 6.396 | 6.881 | 0,06 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.08.2037 (a) | $ | 3.620 | 2.961 | 0,02 |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 1.822 | 1.470 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.07.2047 | | 25.027 | 20.196 | 0,16 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 79 | 66 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 10.569 | 7.953 | 0,06 |
| 0,702 % fällig am 25.08.2036 | | 10.538 | 7.970 | 0,06 |
| 0,722 % fällig am 25.09.2047 (a) | | 42.158 | 32.866 | 0,26 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust (a)** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.11.2035 | | 7 | 5 | 0,00 |
| 1,874 % fällig am 25.08.2035 | | 765 | 595 | 0,00 |
| **Deutsche Alternative-B Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,005 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 1.428 | 1.192 | 0,01 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,072 % fällig am 25.06.2034 | | 2.539 | 2.172 | 0,02 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,222 % fällig am 19.09.2044 | | 31 | 30 | 0,00 |
| **Dragon Finance BV** | | | | |
| 1,952 % fällig am 13.07.2023 | £ | 6.657 | 9.153 | 0,07 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 1,322 % fällig am 28.05.2037 | $ | 5.220 | $ 5.178 | 0,04 |
| **Emerald Mortgages No.4 PLC** | | | | |
| 0,051 % fällig am 15.07.2048 | € | 18.256 | 18.663 | 0,15 |
| **EMF-NL** | | | | |
| 0,948 % fällig am 17.07.2041 | | 3.814 | 4.040 | 0,03 |
| **Eurosail-UK PLC** | | | | |
| 0,035 % fällig am 13.03.2045 | | 1.157 | 1.191 | 0,01 |
| 0,745 % fällig am 13.03.2045 | £ | 61 | 86 | 0,00 |
| 1,355 % fällig am 13.09.2045 | | 38.409 | 50.159 | 0,40 |
| **Extended Stay America Trust** | | | | |
| 3,604 % fällig am 05.12.2031 | $ | 6.000 | 6.022 | 0,05 |
| **FHLMC Multifamily Structured Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,739 % fällig am 25.03.2020 | | 48.863 | 1.210 | 0,01 |
| 0,832 % fällig am 25.01.2023 | | 27.547 | 1.263 | 0,01 |
| 1,009 % fällig am 25.01.2020 | | 158.722 | 5.320 | 0,04 |
| 1,342 % fällig am 25.06.2021 | | 7.362 | 409 | 0,00 |
| 1,370 % fällig am 25.11.2019 | | 94.029 | 4.285 | 0,03 |
| 1,375 % fällig am 25.11.2019 | | 15.204 | 644 | 0,01 |
| 1,478 % fällig am 25.01.2019 | | 54.251 | 2.125 | 0,02 |
| 1,540 % fällig am 25.12.2018 | | 32.615 | 1.266 | 0,01 |
| 1,568 % fällig am 25.10.2018 | | 34.041 | 1.291 | 0,01 |
| 1,700 % fällig am 25.07.2019 | | 33.316 | 1.647 | 0,01 |
| 1,771 % fällig am 25.05.2019 | | 25.630 | 1.275 | 0,01 |
| **First Flexible No.7 PLC** | | | | |
| 0,823 % fällig am 15.09.2033 | £ | 383 | 550 | 0,00 |
| **First Frankin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,912 % fällig am 25.07.2035 | $ | 5.327 | 4.628 | 0,04 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.08.2036 | | 8.625 | 6.102 | 0,05 |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | | 4.840 | 4.543 | 0,04 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.07.2036 | | 10.240 | 6.271 | 0,05 |
| 1,122 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 5.196 | 3.562 | 0,03 |
| 2,255 % fällig am 25.03.2035 | | 3.146 | 2.499 | 0,02 |
| 2,343 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 9.716 | 8.168 | 0,07 |
| 2,359 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 3.854 | 3.146 | 0,03 |
| 2,407 % fällig am 25.02.2036 | | 926 | 748 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 25.05.2020 | | 17 | 17 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 (a) | | 926 | 857 | 0,01 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | | |
| 2,802 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 146 | 124 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust (a)** | | | | |
| 2,121 % fällig am 25.11.2036 | | 2.356 | 2.028 | 0,02 |
| 2,447 % fällig am 25.07.2037 | | 3.295 | 2.754 | 0,02 |
| 2,619 % fällig am 25.11.2037 | | 2.494 | 2.218 | 0,02 |
| 2,698 % fällig am 25.08.2037 | | 1.631 | 1.314 | 0,01 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.08.2037 | | 169 | 87 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.10.2036 | | 13.704 | 7.142 | 0,06 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2036 | | 9.442 | 8.116 | 0,07 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2036 | | 12.322 | 10.507 | 0,08 |
| 0,752 % fällig am 25.01.2036 | | 1.300 | 1.067 | 0,01 |
| 1,142 % fällig am 25.06.2035 | | 1.654 | 1.627 | 0,01 |
| 1,442 % fällig am 25.01.2035 | | 8.188 | 4.532 | 0,04 |
| 1,487 % fällig am 25.06.2035 | | 5.561 | 4.789 | 0,04 |
| **GE Commercial Mortgage Corporation Trust** | | | | |
| 5,483 % fällig am 10.12.2049 | | 13.017 | 13.490 | 0,11 |
| **German Residential Funding Ltd.** | | | | |
| 0,896 % fällig am 27.11.2024 | € | 6.898 | 7.548 | 0,06 |
| **Giovecca Mortgages SRL** | | | | |
| 0,547 % fällig am 23.04.2048 | | 4.168 | 4.502 | 0,04 |
| **GMAC Commercial Mortgage Securities, Inc.** | | | | |
| 5,044 % fällig am 10.12.2041 | $ | 5.000 | 5.083 | 0,04 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,020 % fällig am 18.03.2035 | | 276 | 271 | 0,00 |
| 3,200 % fällig am 19.11.2035 | | 191 | 177 | 0,00 |
| 3,444 % fällig am 19.07.2035 | | 812 | 714 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 | | 1.826 | 1.729 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | | 2.743 | 2.587 | 0,02 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,716 % fällig am 18.03.2039 | £ | 9.343 | 13.082 | 0,10 |
| 0,736 % fällig am 18.06.2038 | | 6.755 | 9.415 | 0,08 |
| **Grecale RMBS Srl** | | | | |
| 0,447 % fällig am 27.01.2061 | € | 6.712 | 7.192 | 0,06 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Greenpoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.10.2045 | $ | 18 | $ 15 | 0,00 |
| 0,732 % fällig am 25.10.2045 | | 5.833 | 4.776 | 0,04 |
| **GreenPoint MTA Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2045 | | 2.428 | 2.154 | 0,02 |
| **Greenwich Capital Acceptance,Inc.** | | | | |
| 6,736 % fällig am 26.07.2024 | | 82 | 72 | 0,00 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 28.08.2039 | € | 23.263 | 18.502 | 0,15 |
| **GS Mortgage Securities Corp. II** | | | | |
| 1,620 % fällig am 10.02.2046 | $ | 38.209 | 3.183 | 0,03 |
| **GS Mortgage Securities Corporation Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,213 % fällig am 25.07.2035 | | 37 | 37 | 0,00 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.12.2046 | | 1.374 | 710 | 0,01 |
| 0,802 % fällig am 25.01.2036 | | 465 | 65 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 1.257 | 1.155 | 0,01 |
| **GSAA Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.05.2047 | | 429 | 317 | 0,00 |
| 5,800 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 11.222 | 5.770 | 0,05 |
| 5,983 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 8.558 | 4.785 | 0,04 |
| 6,205 % fällig am 25.03.2046 (a) | | 2.655 | 2.639 | 0,02 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.09.2036 | | 24.687 | 11.657 | 0,09 |
| 0,542 % fällig am 25.12.2036 | | 7.742 | 4.278 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | | 8.401 | 7.319 | 0,06 |
| 0,582 % fällig am 25.10.2046 | | 6.686 | 6.618 | 0,05 |
| 0,682 % fällig am 25.02.2046 | | 1.594 | 1.196 | 0,01 |
| 0,792 % fällig am 25.03.2047 | | 4.500 | 2.985 | 0,02 |
| 0,812 % fällig am 25.01.2036 | | 5.900 | 4.936 | 0,04 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 8.995 | 5.159 | 0,04 |
| 1,292 % fällig am 25.11.2034 | | 3.241 | 2.988 | 0,02 |
| 1,472 % fällig am 25.06.2034 | | 797 | 769 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,250 % fällig am 25.05.2034 | | 527 | 508 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 15.820 | 13.841 | 0,11 |
| 2,775 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 714 | 591 | 0,00 |
| 2,795 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 1.940 | 1.703 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 2.311 | 2.329 | 0,02 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 19.12.2036 (a) | | 3.640 | 2.727 | 0,02 |
| 0,582 % fällig am 19.11.2046 (a) | | 3.271 | 2.474 | 0,02 |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | | 11.502 | 9.638 | 0,08 |
| 0,672 % fällig am 19.03.2035 | | 3.175 | 2.817 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 19.06.2034 | | 24 | 22 | 0,00 |
| 1,002 % fällig am 19.04.2034 | | 654 | 599 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 19.01.2035 | | 698 | 565 | 0,00 |
| 1,172 % fällig am 19.02.2036 | | 5.503 | 4.395 | 0,04 |
| 1,757 % fällig am 19.09.2035 (a) | | 702 | 473 | 0,00 |
| 2,257 % fällig am 19.01.2036 | | 1.993 | 1.297 | 0,01 |
| 2,430 % fällig am 19.11.2034 | | 1.308 | 1.225 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 642 | 540 | 0,00 |
| 2,803 % fällig am 19.12.2035 (a) | | 5.756 | 5.107 | 0,04 |
| 3,108 % fällig am 19.06.2036 (a) | | 1.484 | 1.010 | 0,01 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | £ | 3.677 | 5.341 | 0,04 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.10.2033 | $ | 2.124 | 1.964 | 0,02 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,400 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 2.887 | 1.903 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.11.2036 | | 12.634 | 10.099 | 0,08 |
| 0,592 % fällig am 25.04.2037 | | 1.067 | 673 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.03.2036 | | 4.300 | 2.975 | 0,02 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.07.2035 | | 41 | 39 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.12.2036 | | 5.000 | 2.990 | 0,02 |
| 0,602 % fällig am 25.02.2036 | | 1.687 | 1.618 | 0,01 |
| 0,642 % fällig am 25.12.2036 | | 18.274 | 7.892 | 0,06 |
| 0,682 % fällig am 25.04.2037 | | 8.304 | 4.826 | 0,04 |
| 0,712 % fällig am 25.11.2035 | | 788 | 745 | 0,01 |
| 0,832 % fällig am 25.01.2036 | | 6.000 | 4.325 | 0,03 |
| **IM Pastor 2 FTH** | | | | |
| 0,049 % fällig am 22.09.2041 | € | 1.042 | 1.100 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.03.2035 (a) | $ | 702 | 596 | 0,00 |
| 1,222 % fällig am 25.03.2033 | | 254 | 248 | 0,00 |
| 6,060 % fällig am 25.10.2034 | | 1.205 | 1.195 | 0,01 |
| **Impac Secured Assets CMN Owner Trust** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.03.2036 | $ | 4.998 | $ 3.627 | 0,03 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 5.750 | 4.115 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 11.061 | 8.714 | 0,07 |
| 0,622 % fällig am 25.11.2036 | | 3.225 | 2.286 | 0,02 |
| 0,662 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 10.279 | 7.387 | 0,06 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2036 | | 4.453 | 4.094 | 0,03 |
| **Indus Eclipse PLC** | | | | |
| 0,829 % fällig am 25.01.2020 | £ | 2.025 | 2.906 | 0,02 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,842 % fällig am 25.01.2032 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.07.2047 | | 11.395 | 8.263 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (a) | | 1.759 | 1.590 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 3.324 | 2.969 | 0,02 |
| **IndyMac INDA Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,668 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 6.713 | 5.244 | 0,04 |
| 2,791 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 1.082 | 928 | 0,01 |
| 2,881 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 92 | 86 | 0,00 |
| 2,909 % fällig am 25.11.2037 | | 119 | 112 | 0,00 |
| 4,682 % fällig am 25.08.2036 | | 488 | 468 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.07.2036 | | 15.673 | 12.512 | 0,10 |
| 0,602 % fällig am 25.02.2037 | | 2.918 | 2.818 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.07.2036 | | 3.501 | 2.820 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 25.05.2046 | | 12.400 | 10.251 | 0,08 |
| 0,652 % fällig am 25.04.2035 | | 1.716 | 1.505 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.09.2037 | | 275 | 236 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.06.2036 | | 10.029 | 8.666 | 0,07 |
| 1,202 % fällig am 25.12.2034 | | 2.086 | 1.782 | 0,01 |
| 1,242 % fällig am 25.11.2034 (a) | | 3.374 | 2.781 | 0,02 |
| 1,282 % fällig am 25.09.2034 | | 132 | 121 | 0,00 |
| 2,511 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 6.191 | 5.311 | 0,04 |
| 2,651 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 99 | 77 | 0,00 |
| 2,718 % fällig am 25.05.2035 (a) | | 162 | 129 | 0,00 |
| 2,747 % fällig am 25.09.2035 (a) | | 619 | 514 | 0,00 |
| 2,816 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 797 | 660 | 0,01 |
| 2,839 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 536 | 413 | 0,00 |
| 2,865 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 4.723 | 3.125 | 0,03 |
| 2,891 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 2.188 | 1.676 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 2.234 | 1.716 | 0,01 |
| 3,027 % fällig am 25.01.2037 | | 2.773 | 2.562 | 0,02 |
| 4,169 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 8.936 | 6.959 | 0,06 |
| **IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates** | | | | |
| 6,750 % fällig am 25.02.2028 | | 76 | 77 | 0,00 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 1,352 % fällig am 25.09.2035 | | 2.614 | 2.475 | 0,02 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 10.620 | 9.737 | 0,08 |
| 0,572 % fällig am 25.03.2037 | | 5.568 | 5.289 | 0,04 |
| 0,942 % fällig am 25.01.2036 | | 420 | 390 | 0,00 |
| 1,799 % fällig am 26.05.2037 | | 9.347 | 8.399 | 0,07 |
| 2,561 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 3.880 | 2.984 | 0,02 |
| 2,737 % fällig am 25.01.2036 | | 1.286 | 1.079 | 0,01 |
| 5,710 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 4.743 | 4.588 | 0,04 |
| 6,120 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 6.756 | 6.387 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,550 % fällig am 15.04.2046 | | 25.024 | 1.831 | 0,01 |
| 1,845 % fällig am 15.05.2045 | | 29.233 | 2.190 | 0,02 |
| 5,186 % fällig am 12.09.2037 | | 7.830 | 7.623 | 0,06 |
| 5,561 % fällig am 12.01.2038 | | 2.000 | 2.092 | 0,02 |
| 5,811 % fällig am 12.06.2043 | | 21.969 | 22.146 | 0,18 |
| **JPMorgan Commercial Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 5,637 % fällig am 18.03.2051 | | 2.810 | 2.886 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.05.2035 | | 8.923 | 8.801 | 0,07 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | | 9.087 | 8.869 | 0,07 |
| 0,762 % fällig am 25.02.2036 | | 6.371 | 5.049 | 0,04 |
| 0,832 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 1.200 | 998 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 7.000 | 6.258 | 0,05 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2036 | | 5.210 | 4.815 | 0,04 |
| 0,662 % fällig am 25.05.2037 | | 2.320 | 1.781 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.07.2036 | | 6.700 | 4.914 | 0,04 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2037 | | 5.313 | 3.928 | 0,03 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | | 26.024 | 20.945 | 0,17 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | | 5.415 | 3.838 | 0,03 |
| 3,422 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 2.095 | 1.440 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,048 % fällig am 27.07.2037 | $ | 1.933 | $ 1.808 | 0,01 |
| 2,189 % fällig am 25.06.2034 | | 70 | 70 | 0,00 |
| 2,535 % fällig am 25.07.2035 | | 239 | 213 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 17 | 15 | 0,00 |
| 2,555 % fällig am 25.11.2035 | | 4.320 | 4.058 | 0,03 |
| 2,640 % fällig am 25.08.2036 | | 1.013 | 814 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 236 | 196 | 0,00 |
| 2,667 % fällig am 25.04.2035 (a) | | 554 | 306 | 0,00 |
| 2,748 % fällig am 25.09.2035 | | 4.354 | 4.180 | 0,03 |
| 2,758 % fällig am 25.08.2035 | | 261 | 153 | 0,00 |
| 5,803 % fällig am 25.10.2036 | | 1.351 | 1.188 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2022 (a) | | 4 | 4 | 0,00 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,923 % fällig am 27.09.2036 | | 217 | 217 | 0,00 |
| 5,424 % fällig am 27.05.2037 | | 4.428 | 4.518 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 26.05.2037 | | 985 | 817 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 26.09.2036 | | 3.506 | 2.404 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 27.02.2037 | | 1.718 | 1.758 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 27.01.2037 | | 1.440 | 1.496 | 0,01 |
| **Kensington Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 0,045 % fällig am 14.06.2040 | € | 3.186 | 3.229 | 0,03 |
| **LB Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,517 % fällig am 15.07.2044 | $ | 6.933 | 7.200 | 0,06 |
| 5,853 % fällig am 15.07.2044 | | 7.181 | 7.446 | 0,06 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,606 % fällig am 15.06.2038 | | 55.966 | 55.457 | 0,44 |
| 5,858 % fällig am 15.07.2040 | | 9.781 | 10.074 | 0,08 |
| **Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.04.2040 (a) | | 351 | 357 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust (a)** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.07.2037 | | 3.882 | 3.003 | 0,02 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2035 | | 2.784 | 2.280 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 4.240 | 3.164 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 370 | 284 | 0,00 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 | | 6.678 | 5.937 | 0,05 |
| 0,622 % fällig am 25.08.2046 | | 18.014 | 14.694 | 0,12 |
| 0,994 % fällig am 25.03.2047 | | 8.908 | 7.257 | 0,06 |
| 1,121 % fällig am 25.08.2047 | | 39.858 | 27.173 | 0,22 |
| 5,890 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 1.475 | 1.394 | 0,01 |
| 6,290 % fällig am 24.06.2046 | | 10.280 | 8.570 | 0,07 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,522 % fällig am 25.07.2036 | | 5.320 | 2.268 | 0,02 |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | | 11.428 | 4.923 | 0,04 |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | | 29.489 | 19.067 | 0,15 |
| 0,802 % fällig am 25.08.2045 | | 6.185 | 5.772 | 0,05 |
| 1,202 % fällig am 25.08.2035 | | 20.000 | 14.887 | 0,12 |
| 1,472 % fällig am 25.06.2035 | | 4.875 | 3.741 | 0,03 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 0,401 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 2.240 | 1.849 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | | 8.511 | 6.247 | 0,05 |
| 0,612 % fällig am 25.05.2046 | | 407 | 314 | 0,00 |
| **Manufactured Housing Contract Trust Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,672 % fällig am 20.04.2032 | | 4.294 | 3.784 | 0,03 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | € | 36.862 | 39.243 | 0,31 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.03.2035 | $ | 1.182 | 932 | 0,01 |
| 2,688 % fällig am 25.02.2035 | | 860 | 792 | 0,01 |
| 2,868 % fällig am 25.03.2035 | | 460 | 400 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loans Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.05.2034 | | 239 | 250 | 0,00 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,472 % fällig am 25.10.2036 | | 5.483 | 2.354 | 0,02 |
| 0,552 % fällig am 25.10.2036 | | 636 | 364 | 0,00 |
| 0,582 % fällig am 25.10.2036 | | 25.999 | 15.140 | 0,12 |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | | 6.714 | 5.816 | 0,05 |
| 0,662 % fällig am 25.03.2036 | | 6.000 | 3.716 | 0,03 |
| 0,852 % fällig am 25.06.2035 | | 8.303 | 7.942 | 0,06 |
| 0,872 % fällig am 25.10.2035 | | 1.470 | 1.454 | 0,01 |
| 0,922 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 13.951 | 10.411 | 0,08 |
| 1,112 % fällig am 25.03.2035 | | 9.810 | 8.566 | 0,07 |
| 2,147 % fällig am 25.02.2034 | | 1.300 | 1.296 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 864 | 825 | 0,01 |
| **MASTR Seasoned Securities Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.10.2032 | | 84 | 75 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | $ | 18.489 | $ 17.335 | 0,14 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.08.2037 | | 16.864 | 10.275 | 0,08 |
| 0,592 % fällig am 25.07.2037 | | 6.306 | 3.362 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2036 | | 11 | 11 | 0,00 |
| 0,732 % fällig am 25.08.2036 | | 4.000 | 3.669 | 0,03 |
| 0,941 % fällig am 25.01.2029 (d) | | 2.760 | 42 | 0,00 |
| 2,328 % fällig am 25.11.2035 | | 484 | 470 | 0,00 |
| 2,921 % fällig am 25.12.2034 | | 560 | 559 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2026 | | 2.050 | 2.224 | 0,02 |
| **MINT PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.02.2025 | € | 17.415 | 18.663 | 0,15 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,512 % fällig am 25.01.2037 | $ | 23.638 | 13.179 | 0,11 |
| 0,522 % fällig am 25.09.2036 | | 10 | 4 | 0,00 |
| 0,532 % fällig am 25.12.2036 | | 6.450 | 3.833 | 0,03 |
| 0,532 % fällig am 25.02.2037 | | 686 | 316 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | | 22.803 | 12.748 | 0,10 |
| 0,632 % fällig am 25.01.2037 | | 10.300 | 5.851 | 0,05 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | | 53.487 | 35.531 | 0,28 |
| 1,127 % fällig am 25.12.2034 | | 1.592 | 1.453 | 0,01 |
| 1,337 % fällig am 25.03.2035 | | 2.625 | 2.283 | 0,02 |
| 1,352 % fällig am 25.11.2034 | | 8.989 | 8.549 | 0,07 |
| 1,397 % fällig am 25.04.2035 | | 5.104 | 4.796 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | | |
| 1,282 % fällig am 15.02.2047 | | 13.634 | 797 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,569 % fällig am 15.12.2044 | | 23.528 | 24.511 | 0,20 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.04.2036 | | 11.691 | 8.252 | 0,07 |
| 0,892 % fällig am 25.08.2035 | | 9.295 | 9.038 | 0,07 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,691 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 256 | 182 | 0,00 |
| 2,855 % fällig am 25.08.2034 | | 386 | 381 | 0,00 |
| 2,862 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 145 | 118 | 0,00 |
| 4,287 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 4.451 | 3.479 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2037 (a) | | 1.085 | 1.022 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 2.834 | 2.712 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 (a) | | 5.083 | 4.213 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2047 | | 4.483 | 1.393 | 0,01 |
| 6,354 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 1.789 | 839 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 192 | 161 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.11.2034 | | 1.022 | 997 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 26.08.2047 | | 3.576 | 3.672 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Resecuritization Trust** | | | | |
| 0,531 % fällig am 26.01.2051 | | 11.287 | 10.812 | 0,09 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.10.2035 | | 986 | 908 | 0,01 |
| 1,494 % fällig am 25.02.2035 | | 60 | 59 | 0,00 |
| **Multi Security Asset Trust LP Commercial Mortgage- Backed Securities Pass-Through** | | | | |
| 5,460 % fällig am 28.11.2035 | | 5.000 | 5.001 | 0,04 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.06.2037 | | 5.000 | 4.366 | 0,04 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.02.2036 | | 377 | 377 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.12.2035 | | 4.160 | 4.059 | 0,03 |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | | 509 | 446 | 0,00 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,703 % fällig am 01.12.2050 | £ | 5.088 | 7.391 | 0,06 |
| 0,749 % fällig am 01.12.2050 | | 3.153 | 4.262 | 0,03 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.12.2035 | $ | 1.203 | 540 | 0,00 |
| 1,442 % fällig am 25.08.2034 | | 2.099 | 2.044 | 0,02 |
| 2,991 % fällig am 25.07.2035 | | 5.139 | 4.912 | 0,04 |
| 6,408 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 1.064 | 555 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 2.186 | 821 | 0,01 |
| 0,912 % fällig am 25.05.2035 | | 3.472 | 3.330 | 0,03 |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 3.590 | 1.943 | 0,02 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 8.690 | 4.618 | 0,04 |
| 0,572 % fällig am 25.03.2037 | | 1.652 | 868 | 0,01 |
| 0,862 % fällig am 25.01.2036 | | 830 | 678 | 0,01 |
| 0,872 % fällig am 25.01.2036 | | 1.000 | 929 | 0,01 |
| 2,297 % fällig am 25.03.2035 | | 7.100 | 6.337 | 0,05 |
| **Oakwood Mortgage Investors, Inc.** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.12.2031 | $ | 408 | $ 369 | 0,00 |
| 6,990 % fällig am 15.12.2026 | | 2.129 | 2.314 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.05.2037 | | 13.351 | 8.166 | 0,07 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | | 3.857 | 2.346 | 0,02 |
| 0,612 % fällig am 25.01.2036 | | 14.376 | 14.029 | 0,11 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | | 15.775 | 9.243 | 0,07 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | | 5.580 | 3.270 | 0,03 |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | | 6.000 | 5.073 | 0,04 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 16.557 | 21.920 | 0,18 |
| **Paragon Mortgages No.7 PLC** | | | | |
| 0,782 % fällig am 15.05.2034 | $ | 406 | 373 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 0,912 % fällig am 25.09.2035 | | 9.314 | 7.512 | 0,06 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.08.2035 | | 4.051 | 4.046 | 0,03 |
| 0,952 % fällig am 25.07.2035 | | 7.100 | 6.378 | 0,05 |
| 1,262 % fällig am 25.01.2036 | | 2.023 | 1.944 | 0,02 |
| 1,367 % fällig am 25.06.2035 | | 6.250 | 5.482 | 0,04 |
| 1,472 % fällig am 25.09.2034 | | 3.244 | 2.782 | 0,02 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 14.648 | 10.617 | 0,09 |
| 1,217 % fällig am 25.08.2035 | | 5.636 | 5.328 | 0,04 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2046 | | 7.600 | 6.698 | 0,05 |
| 1,052 % fällig am 25.11.2035 | | 2.480 | 2.130 | 0,02 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 491 | 464 | 0,00 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.08.2036 | | 2.700 | 2.397 | 0,02 |
| 1,072 % fällig am 25.06.2047 | | 8.014 | 6.825 | 0,05 |
| 1,385 % fällig am 25.10.2045 | | 2.964 | 2.707 | 0,02 |
| 1,971 % fällig am 25.06.2035 | | 4.357 | 4.231 | 0,03 |
| **RBSCF Trust** | | | | |
| 5,509 % fällig am 16.04.2047 | | 7.400 | 7.427 | 0,06 |
| 5,952 % fällig am 16.02.2051 | | 7.764 | 7.887 | 0,06 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 1.788 | 1.082 | 0,01 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,300 % fällig am 26.12.2036 | | 12.757 | 9.949 | 0,08 |
| 2,550 % fällig am 26.09.2035 | | 13.837 | 9.934 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 26.07.2037 | | 1.605 | 1.183 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 26.08.2037 | | 2.605 | 2.346 | 0,02 |
| 9,391 % fällig am 26.06.2037 | | 3.859 | 2.279 | 0,02 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,797 % fällig am 25.08.2036 | | 25.869 | 16.184 | 0,13 |
| 5,812 % fällig am 25.11.2036 | | 9.768 | 5.369 | 0,04 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 1.584 | 810 | 0,01 |
| 5,893 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 3.250 | 1.666 | 0,01 |
| 6,120 % fällig am 25.11.2036 | | 10.049 | 5.795 | 0,05 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | | 7.579 | 5.872 | 0,05 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 7.039 | 5.458 | 0,04 |
| 0,612 % fällig am 25.07.2037 | | 17.725 | 14.200 | 0,11 |
| 0,612 % fällig am 25.05.2046 (a) | | 8.785 | 7.895 | 0,06 |
| 0,692 % fällig am 25.02.2046 (a) | | 218 | 128 | 0,00 |
| 0,722 % fällig am 25.08.2035 | | 544 | 424 | 0,00 |
| 0,822 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 2.975 | 2.006 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 25.06.2035 (a) | | 128 | 103 | 0,00 |
| 1,472 % fällig am 25.12.2033 | | 329 | 283 | 0,00 |
| 3,069 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 823 | 734 | 0,01 |
| 3,230 % fällig am 25.02.2035 (a) | | 1.857 | 1.521 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 5.551 | 4.499 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2034 | | 4.500 | 4.603 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 16.652 | 13.613 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 1.355 | 1.121 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 462 | 382 | 0,00 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 21.941 | 18.909 | 0,15 |
| 0,642 % fällig am 25.01.2037 | | 5.000 | 3.451 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.02.2037 | | 25.200 | 18.201 | 0,15 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 | | 15.800 | 14.585 | 0,12 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | | 10.895 | 10.525 | 0,08 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | | 6.011 | 3.801 | 0,03 |
| 0,702 % fällig am 25.06.2036 | | 3.500 | 2.799 | 0,02 |
| 0,702 % fällig am 25.09.2036 | | 10.590 | 7.373 | 0,06 |
| 0,742 % fällig am 25.01.2036 | $ | 3.676 | $ 3.606 | 0,03 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | | 2.033 | 2.015 | 0,02 |
| 0,862 % fällig am 25.11.2035 | | 6.959 | 6.045 | 0,05 |
| 0,882 % fällig am 25.09.2035 | | 2.600 | 2.405 | 0,02 |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | | 5.728 | 5.435 | 0,04 |
| 1,067 % fällig am 25.03.2035 | | 2.405 | 2.265 | 0,02 |
| 1,097 % fällig am 25.02.2035 | | 2.185 | 2.090 | 0,02 |
| 1,202 % fällig am 25.06.2034 | | 6.168 | 5.251 | 0,04 |
| 1,667 % fällig am 25.03.2035 | | 823 | 603 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,451 % fällig am 25.12.2035 | | 873 | 637 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.02.2037 | | 5.540 | 5.096 | 0,04 |
| 0,602 % fällig am 25.10.2036 | | 4.927 | 4.869 | 0,04 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2046 | | 3.600 | 3.102 | 0,02 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | | 3.000 | 2.690 | 0,02 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 0,972 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 298 | 221 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | | 7.632 | 7.973 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 767 | 619 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 4.025 | 2.729 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 5.559 | 3.147 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 2.147 | 1.786 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046 (a) | | 1.497 | 1.201 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 3.353 | 3.090 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 1.084 | 910 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.504 | 1.038 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 20.204 | 12.695 | 0,10 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 2,920 % fällig am 25.06.2035 | | 1.064 | 903 | 0,01 |
| 2,960 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 846 | 748 | 0,01 |
| 3,065 % fällig am 25.08.2035 (a) | | 4.682 | 4.365 | 0,04 |
| 3,151 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 342 | 301 | 0,00 |
| 3,368 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 482 | 370 | 0,00 |
| 3,630 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 4.655 | 4.039 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2022 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,025 % fällig am 12.06.2044 | € | 1.151 | 1.144 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 12.06.2044 | $ | 669 | 606 | 0,01 |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | £ | 719 | 957 | 0,01 |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 1.465 | 1.973 | 0,02 |
| **Residential Mortgage Securities 19 PLC** | | | | |
| 0,975 % fällig am 11.02.2038 | | 126 | 173 | 0,00 |
| **Rural Hipotecario I Fondo de Titulizacion Hipotecaria** | | | | |
| 0,161 % fällig am 13.02.2033 | € | 1.079 | 1.147 | 0,01 |
| **Sandwell Commercial Finance No.1 PLC** | | | | |
| 2,015 % fällig am 11.05.2039 | £ | 3.500 | 4.501 | 0,04 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.05.2036 | $ | 11.994 | 6.827 | 0,05 |
| 0,592 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 19.175 | 8.110 | 0,06 |
| 0,622 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 9.628 | 5.825 | 0,05 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | | 14.567 | 7.339 | 0,06 |
| 0,702 % fällig am 25.12.2035 | | 487 | 475 | 0,00 |
| 1,097 % fällig am 25.01.2035 | | 115 | 106 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 1,056 % fällig am 20.02.2034 | | 1.499 | 1.412 | 0,01 |
| **Sestante Finance Srl** | | | | |
| 0,107 % fällig am 23.07.2046 | € | 3.372 | 3.519 | 0,03 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.07.2036 | $ | 19.513 | 7.842 | 0,06 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | | 629 | 234 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | | 4.931 | 4.543 | 0,04 |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 474 | 471 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2037 | | 34.647 | 21.223 | 0,17 |
| 0,602 % fällig am 25.07.2037 | | 14.633 | 9.344 | 0,07 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | | 6.775 | 4.145 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.06.2036 | | 11.482 | 8.797 | 0,07 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,763 % fällig am 10.06.2043 | £ | 438 | 622 | 0,01 |
| **Southern Pacific Secured Asset Corp.** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.03.2028 | $ | 395 | 320 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.11.2037 | | 20.735 | 11.248 | 0,09 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2037 | | 4.038 | 2.186 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 25.06.2036 | | 3.362 | 3.242 | 0,03 |
| 1,397 % fällig am 25.12.2035 | | 7.723 | 6.931 | 0,06 |
| **SRERS Funding Ltd.** | | | | |
| 0,537 % fällig am 09.05.2046 | | 28.517 | 27.690 | 0,22 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAdjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,028 % fällig am 25.10.2037 (a) | $ | 3.590 | $ 3.212 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,642 % fällig am 25.05.2037 | | 2.463 | 2.019 | 0,02 |
| 0,722 % fällig am 25.09.2034 | | 1.009 | 879 | 0,01 |
| 1,685 % fällig am 25.05.2035 (a) | | 6.269 | 3.953 | 0,03 |
| 2,154 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 964 | 720 | 0,01 |
| 2,446 % fällig am 25.08.2034 | | 863 | 868 | 0,01 |
| 2,476 % fällig am 25.02.2035 | | 17.387 | 17.210 | 0,14 |
| 2,516 % fällig am 25.12.2034 | | 61 | 60 | 0,00 |
| 2,522 % fällig am 25.01.2035 | | 1.021 | 944 | 0,01 |
| 2,540 % fällig am 25.09.2034 | | 34 | 33 | 0,00 |
| 2,541 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 2.977 | 2.405 | 0,02 |
| 2,578 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 1.807 | 1.405 | 0,01 |
| 2,609 % fällig am 25.11.2034 | | 43 | 43 | 0,00 |
| 2,719 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 3.381 | 2.917 | 0,02 |
| 2,741 % fällig am 25.11.2037 (a) | | 946 | 755 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.06.2036 (a) | | 1.962 | 1.692 | 0,01 |
| 2,765 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 761 | 572 | 0,00 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.05.2036 | | 4.090 | 3.396 | 0,03 |
| 0,594 % fällig am 25.07.2036 | | 31.148 | 19.042 | 0,15 |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | | 4.000 | 3.767 | 0,03 |
| 1,157 % fällig am 25.08.2035 | | 20.100 | 19.471 | 0,16 |
| 1,322 % fällig am 25.09.2034 | | 4.161 | 4.000 | 0,03 |
| 1,322 % fällig am 25.05.2035 | | 12.458 | 10.446 | 0,08 |
| 1,547 % fällig am 25.07.2033 | | 1.811 | 1.736 | 0,01 |
| 1,802 % fällig am 25.04.2033 | | 36 | 30 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.10.2036 | | 18.208 | 14.571 | 0,12 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | | 13.956 | 11.196 | 0,09 |
| 0,602 % fällig am 25.09.2047 | | 2.254 | 1.944 | 0,02 |
| 0,622 % fällig am 25.02.2036 | | 4.784 | 3.751 | 0,03 |
| 0,632 % fällig am 25.09.2047 (a) | | 7.834 | 5.437 | 0,04 |
| 0,642 % fällig am 25.05.2036 | | 31.447 | 23.642 | 0,19 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2045 | | 215 | 189 | 0,00 |
| 0,882 % fällig am 19.04.2035 | | 16 | 15 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 4.383 | 3.041 | 0,02 |
| 2,429 % fällig am 19.10.2034 | | 1.272 | 1.254 | 0,01 |
| 2,609 % fällig am 25.05.2047 (a) | | 8.089 | 5.714 | 0,05 |
| 2,675 % fällig am 27.12.2035 (a) | | 760 | 606 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,127 % fällig am 25.02.2035 | | 1.843 | 1.491 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.02.2037 | | 1.550 | 1.377 | 0,01 |
| 0,562 % fällig am 25.05.2047 | | 3.559 | 3.466 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 4.225 | 4.183 | 0,03 |
| 0,652 % fällig am 25.05.2047 | | 27.028 | 21.046 | 0,17 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | | 15.000 | 12.646 | 0,10 |
| 0,742 % fällig am 25.05.2037 | | 2.443 | 2.245 | 0,02 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 | | 6.750 | 6.585 | 0,05 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2035 | | 13.600 | 12.337 | 0,10 |
| 0,922 % fällig am 25.11.2037 | | 8.155 | 6.616 | 0,05 |
| 1,322 % fällig am 25.08.2037 | | 8.438 | 8.029 | 0,06 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.02.2034 | | 375 | 353 | 0,00 |
| 5,480 % fällig am 25.07.2034 | | 7.988 | 8.413 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2034 | | 3.746 | 3.825 | 0,03 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.02.2035 | | 1.402 | 1.320 | 0,01 |
| **Talisman-6 Finance PLC** | | | | |
| 0,127 % fällig am 22.10.2016 | € | 610 | 658 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust (a)** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.09.2036 | $ | 587 | 558 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 | | 53 | 48 | 0,00 |
| **TDA CAM 3 FTA** | | | | |
| 0,177 % fällig am 26.04.2033 | € | 597 | 637 | 0,01 |
| **Theatre Hospitals No. 1 PLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 15.10.2031 | £ | 11.098 | 15.402 | 0,12 |
| **Theatre Hospitals No. 2 PLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 15.10.2031 | | 5.458 | 7.574 | 0,06 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,376 % fällig am 25.09.2037 | $ | 3.907 | 3.870 | 0,03 |
| 2,383 % fällig am 25.09.2037 | | 3.520 | 3.406 | 0,03 |
| 4,521 % fällig am 25.10.2046 | | 354 | 344 | 0,00 |
| **Titan Europe Ltd.** | | | | |
| 0,167 % fällig am 23.04.2017 | € | 5.569 | 5.838 | 0,05 |
| **Trapeza CDO X Ltd.** | | | | |
| 0,667 % fällig am 06.07.2041 | $ | 19.360 | $ 14.423 | 0,12 |
| 0,727 % fällig am 06.07.2041 | | 9.000 | 5.085 | 0,04 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 7.400 | 10.817 | 0,09 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,305 % fällig am 10.04.2046 | $ | 10.855 | 721 | 0,01 |
| **Ulysses European Loan Conduit No.27 PLC** | | | | |
| 0,739 % fällig am 25.07.2017 | £ | 30.750 | 43.736 | 0,35 |
| **Vericrest Opportunity Loan Trust** | | | | |
| 3,375 % fällig am 25.10.2058 | $ | 16.679 | 16.446 | 0,13 |
| **VOLT XXII LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.02.2055 | | 12.760 | 12.625 | 0,10 |
| **VOLT XXXIV LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.02.2055 | | 7.262 | 7.142 | 0,06 |
| **Vulcan European Loan Conduit No.28 Ltd.** | | | | |
| 0,199 % fällig am 15.05.2017 | € | 2.443 | 2.627 | 0,02 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,952 % fällig am 15.02.2051 | $ | 1.600 | 1.655 | 0,01 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC Trust** | | | | |
| 2,775 % fällig am 20.08.2035 (a) | | 6.056 | 5.299 | 0,04 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.07.2047 | | 9.040 | 5.373 | 0,04 |
| 0,612 % fällig am 25.04.2037 | | 38.634 | 17.655 | 0,14 |
| 0,672 % fällig am 25.07.2047 | | 10.089 | 6.063 | 0,05 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,957 % fällig am 25.03.2047 (a) | | 1.705 | 1.297 | 0,01 |
| 1,007 % fällig am 25.06.2047 | | 11.074 | 8.885 | 0,07 |
| 1,901 % fällig am 25.07.2047 (a) | | 4.694 | 3.201 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,067 % fällig am 25.07.2047 | | 22.497 | 18.290 | 0,15 |
| 1,137 % fällig am 25.10.2046 (a) | | 20.031 | 15.940 | 0,13 |
| 1,878 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 1.860 | 1.593 | 0,01 |
| 1,972 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 4.566 | 3.894 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 5.428 | 4.635 | 0,04 |
| 2,096 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 3.137 | 2.613 | 0,02 |
| 2,151 % fällig am 25.10.2046 | | 5.474 | 4.938 | 0,04 |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 4.556 | 4.072 | 0,03 |
| 2,194 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 1.743 | 1.520 | 0,01 |
| 2,258 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 2.607 | 2.252 | 0,02 |
| 2,341 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 547 | 500 | 0,00 |
| 2,380 % fällig am 25.07.2037 (a) | | 15.476 | 13.950 | 0,11 |
| 2,446 % fällig am 25.04.2035 | | 11.000 | 10.881 | 0,09 |
| 2,523 % fällig am 25.12.2035 | | 164 | 159 | 0,00 |
| 3,680 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 10.856 | 9.721 | 0,08 |
| 4,276 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 749 | 672 | 0,01 |
| 5,877 % fällig am 25.08.2046 (a) | | 725 | 668 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.05.2035 (a) | | 12.736 | 10.083 | 0,08 |
| 1,017 % fällig am 25.04.2047 (a) | | 12.995 | 9.559 | 0,08 |
| 1,177 % fällig am 25.09.2046 (a) | | 8.903 | 6.008 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 3.764 | 3.676 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 (a) | | 577 | 528 | 0,00 |
| 6,449 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 2.928 | 1.466 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 10.022 | 7.676 | 0,06 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,411 % fällig am 25.01.2035 | | 874 | 721 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,778 % fällig am 27.08.2035 | | 337 | 339 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.09.2036 (a)(h) | | 2 | 1 | 0,00 |
| 1,222 % fällig am 25.01.2036 | | 3.642 | 3.508 | 0,03 |
| 2,683 % fällig am 25.04.2035 | | 13.862 | 14.056 | 0,11 |
| 2,733 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 372 | 355 | 0,00 |
| 2,738 % fällig am 25.06.2035 | | 9.975 | 10.144 | 0,08 |
| 2,740 % fällig am 25.05.2035 | | 1.852 | 1.866 | 0,02 |
| 2,740 % fällig am 26.06.2035 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 348 | 341 | 0,00 |
| 2,752 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 12.275 | 11.645 | 0,09 |
| 2,851 % fällig am 25.12.2034 | | 12 | 12 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2036 | | 973 | 922 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (a) | | 25 | 25 | 0,00 |
| **WF-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,306 % fällig am 15.03.2045 | | 9.609 | 213 | 0,00 |
| 0,329 % fällig am 15.03.2047 | | 97.000 | 3.518 | 0,03 |
| 0,431 % fällig am 15.03.2047 | | 83.200 | 2.884 | 0,02 |
| 1,470 % fällig am 15.03.2045 | | 176.513 | 10.489 | 0,08 |
| **Windermere XIV CMBS Ltd.** | | | | |
| 0,397 % fällig am 22.04.2018 | € | 530 | $ 548 | 0,00 |
| | | | 4.623.040 | 36,92 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Adagio II CLO PLC** | | | | |
| 5,152 % fällig am 15.01.2021 | | 8.500 | 9.281 | 0,07 |
| **Aeolos S.A.** | | | | |
| 0,509 % fällig am 31.03.2019 | | 4.753 | 4.542 | 0,04 |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets 5 SPV Srl** | | | | |
| 1,449 % fällig am 20.04.2040 | | 923 | 1.004 | 0,01 |
| **ALESCO Preferred Funding VII Ltd.** | | | | |
| 1,113 % fällig am 23.07.2035 | $ | 15.152 | 9.015 | 0,07 |
| **ALESCO Preferred Funding VIII Ltd.** | | | | |
| 0,973 % fällig am 23.12.2035 | | 46.252 | 34.227 | 0,27 |
| **ALESCO Preferred Funding XV Ltd.** | | | | |
| 0,873 % fällig am 23.12.2037 | | 15.309 | 11.711 | 0,09 |
| **Alesco Preferred Funding XVII Ltd.** | | | | |
| 1,343 % fällig am 23.09.2038 | | 11.684 | 8.471 | 0,07 |
| **Anthracite CDO III Ltd.** | | | | |
| 1,170 % fällig am 23.03.2039 | | 3.481 | 3.420 | 0,03 |
| **Arbor Realty Collateralized Loan Obligation Ltd.** | | | | |
| 2,081 % fällig am 15.09.2025 | | 15.000 | 14.908 | 0,12 |
| **ARCap Resecuritization Trust** | | | | |
| 4,730 % fällig am 21.04.2024 | | 216 | 218 | 0,00 |
| **ARES XII CLO Ltd.** | | | | |
| 1,023 % fällig am 25.11.2020 | | 962 | 949 | 0,01 |
| **Capmark VII-CRE Delaware Corp.** | | | | |
| 0,701 % fällig am 15.08.2036 | | 3.236 | 3.194 | 0,03 |
| 0,851 % fällig am 15.08.2036 | | 8.002 | 7.362 | 0,06 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 1,547 % fällig am 20.04.2022 | | 32.150 | 31.999 | 0,26 |
| **Chapel BV** | | | | |
| 0,308 % fällig am 17.07.2066 | € | 15.557 | 15.850 | 0,13 |
| **Cifc Funding Ltd.** | | | | |
| 0,556 % fällig am 15.04.2021 | $ | 8.878 | 8.866 | 0,07 |
| **COA Summit CLO Ltd.** | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.04.2023 | | 12.401 | 12.383 | 0,10 |
| **Dekania Europe CDO II PLC** | | | | |
| 0,109 % fällig am 27.09.2037 | € | 16.685 | 16.856 | 0,13 |
| **FAB CBO BV** | | | | |
| 0,593 % fällig am 20.08.2080 | | 571 | 617 | 0,00 |
| 0,743 % fällig am 20.08.2080 | | 6.500 | 6.580 | 0,05 |
| **FAB US Ltd.** | | | | |
| 1,242 % fällig am 06.12.2045 | £ | 2.015 | 2.682 | 0,02 |
| **Goldentree Loan Opportunities V Ltd.** | | | | |
| 1,010 % fällig am 18.10.2021 | $ | 2.302 | 2.293 | 0,02 |
| **Gramercy Real Estate CDO Ltd.** | | | | |
| 0,770 % fällig am 25.07.2035 | | 19.239 | 19.143 | 0,15 |
| 1,120 % fällig am 25.07.2035 | | 3.500 | 3.343 | 0,03 |
| **Halcyon Structured Asset Management European CLO II BV** | | | | |
| 0,469 % fällig am 25.01.2023 | € | 1.000 | 1.064 | 0,01 |
| **Harbourmaster CLO 10 BV** | | | | |
| 0,881 % fällig am 06.02.2024 | | 2.016 | 2.190 | 0,02 |
| **Harbourmaster CLO 6 BV** | | | | |
| 0,367 % fällig am 25.10.2020 | | 484 | 522 | 0,00 |
| **Harbourmaster CLO 9 BV** | | | | |
| 0,136 % fällig am 08.05.2023 | | 1.866 | 2.024 | 0,02 |
| 0,600 % fällig am 08.05.2023 | $ | 12.362 | 12.174 | 0,10 |
| 0,859 % fällig am 08.05.2023 | £ | 17.291 | 25.074 | 0,20 |
| **Harbourmaster Pro-rata CLO 2 BV** | | | | |
| 0,311 % fällig am 15.10.2022 | € | 15.000 | 15.549 | 0,12 |
| **Harvest CLO III-A S.A.** | | | | |
| 4,426 % fällig am 08.06.2021 | | 3.250 | 3.578 | 0,03 |
| **Highlander Euro CDO BV** | | | | |
| 0,488 % fällig am 06.09.2022 | | 7.558 | 8.184 | 0,06 |
| **LCM IX LP** | | | | |
| 1,521 % fällig am 14.07.2022 | $ | 24.538 | 24.519 | 0,20 |
| **Leopard CLO II BV** | | | | |
| 1,754 % fällig am 07.04.2019 | € | 1.026 | 1.116 | 0,01 |
| **Leopard CLO V BV** | | | | |
| 0,389 % fällig am 24.07.2023 | | 2.300 | 2.465 | 0,02 |
| **Madison Park Funding VIII Ltd.** | | | | |
| 1,570 % fällig am 22.04.2022 | $ | 33.274 | 33.273 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Malin CLO BV** | | | | |
| 0,846 % fällig am 07.05.2023 | £ | 8.033 | $ 11.711 | 0,09 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 26.06.2028 | $ | 10.099 | 9.823 | 0,08 |
| 0,672 % fällig am 27.03.2028 | | 9.574 | 9.227 | 0,07 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2029 | | 18.002 | 17.737 | 0,14 |
| 0,983 % fällig am 25.06.2029 | | 6.342 | 5.713 | 0,05 |
| **NCT Funding Ltd.** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.04.2040 | | 212 | 207 | 0,00 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 1,470 % fällig am 25.07.2023 | | 22.000 | 21.942 | 0,17 |
| **N-Star REL CDO VI Ltd.** | | | | |
| 0,848 % fällig am 16.06.2041 | | 11.420 | 11.191 | 0,09 |
| **OHA Credit Partners VI Ltd.** | | | | |
| 1,582 % fällig am 15.05.2023 | | 57.470 | 57.189 | 0,46 |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | | |
| 2,470 % fällig am 18.09.2024 | | 27.000 | 26.981 | 0,21 |
| **Pangaea ABS SPV** | | | | |
| 0,129 % fällig am 28.12.2096 | € | 4.479 | 4.711 | 0,04 |
| **Panther CDO V BV** | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | | 21.294 | 22.234 | 0,18 |
| **Race Point V CLO Ltd.** | | | | |
| 1,812 % fällig am 15.12.2022 | $ | 1.963 | 1.951 | 0,02 |
| **RMF Euro CDO V PLC** | | | | |
| 0,419 % fällig am 18.07.2023 | € | 3.900 | 4.161 | 0,03 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 3,581 % fällig am 16.05.2044 | $ | 8.317 | 8.593 | 0,07 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,410 % fällig am 26.01.2026 | | 17.200 | 16.454 | 0,13 |
| 0,497 % fällig am 25.01.2040 | € | 900 | 737 | 0,01 |
| **Sorin Real Estate CDO IV Ltd.** | | | | |
| 0,713 % fällig am 28.10.2046 | $ | 11.400 | 10.545 | 0,08 |
| **SpringCastle America Funding LLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.05.2023 | | 7.366 | 7.352 | 0,06 |
| **Stichting Halcyon Structured Asset Management European CLO** | | | | |
| 0,369 % fällig am 24.07.2023 | € | 7.500 | 8.058 | 0,06 |
| **Trapeza CDO Xii Ltd.** | | | | |
| 0,617 % fällig am 06.04.2042 | $ | 5.991 | 4.314 | 0,03 |
| **Tropic CDO V Ltd.** | | | | |
| 0,641 % fällig am 15.07.2036 | | 25.547 | 16.989 | 0,14 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,702 % fällig am 14.03.2022 | | 10.939 | 10.906 | 0,09 |
| **Wasatch Ltd.** | | | | |
| 0,602 % fällig am 14.11.2022 | | 15.741 | 15.348 | 0,12 |
| **Wrightwood Capital Real Estate CDO Ltd.** | | | | |
| 0,698 % fällig am 21.11.2040 | | 20.332 | 19.864 | 0,16 |
| | | | 684.584 | 5,47 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | $ | 1.768 | $ 1.755 | 0,01 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 70.800 | 16.695 | 0,13 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 70.800 | 16.051 | 0,13 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B (e)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2045 | | 62.860 | 37.559 | 0,30 |
| 6,000 % fällig am 15.08.2050 | | 268.060 | 163.730 | 1,31 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 31.993 | 6.457 | 0,05 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 127.700 | 24.307 | 0,19 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 278.175 | 50.307 | 0,40 |
| **Corporation Andina de Fomento (e)** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 | MXN | 11.195 | 646 | 0,01 |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | $ | 5.724 | 4.794 | 0,04 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 24.02.2023 | € | 859 | 698 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2024 | | 1.877 | 1.485 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2025 | | 859 | 663 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2026 | | 1.929 | 1.441 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2027 | | 859 | 633 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2028 | | 859 | 620 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2029 | | 859 | 603 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2030 | | 859 | 588 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2031 | | 859 | 580 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2032 | | 859 | 566 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2033 | | 859 | 562 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2034 | | 7.646 | 4.899 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2035 | | 1.629 | 1.034 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2036 | | 1.789 | 1.124 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2037 | | 859 | 523 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2038 | | 859 | 534 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2039 | | 1.329 | 831 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2040 | | 859 | 536 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2041 | | 859 | 537 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2042 | | 859 | 538 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 08.11.2016 | JPY | 1.660.000 | 13.109 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 17.04.2019 | € | 2.680 | 2.679 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | JPY | 1.242.300 | 9.966 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 1.030.800 | 8.258 | 0,07 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,095 %) fällig am 29.02.2016 | | 18.680.000 | 155.290 | 1,24 |
| (0,069 %) fällig am 07.03.2016 | | 67.980.000 | 565.133 | 4,51 |
| (0,040 %) fällig am 07.04.2016 | | 33.040.000 | 274.674 | 2,19 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 1.500 | 1.365 | 0,01 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | $ | 25.400 | 24.146 | 0,19 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2043 | | 9.200 | 8.992 | 0,07 |
| | | | 1.404.908 | 11,22 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | |
| EME Reorganization Trust | 5.207.199 | $ 52 | 0,00 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Eurobank Ergasias S.A. | 40.899.918 | 45.801 | 0,37 |
| National Bank of Greece S.A. | 6.325.150 | 2.337 | 0,02 |
| Towergate Finance PLC (I) | 1.254.974 | 1.295 | 0,01 |
| | | 49.433 | 0,40 |
| | | 49.485 | 0,40 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 8,500 % | 6.255 | 161 | 0,00 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (i)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 105.677.594 | 1.056.987 | 8,44 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 12.781.408** | **102,08** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2016 | 6.905 | $ (853) | (0,01) |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 84 | 30 | 0,00 |
| | | | | $ (823) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (823)** | **(0,01)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-20 Index | 5,000 % | 20.12.2018 | $ 29.072 | $ (1.603) | (0,01) |
| CDX.EM-21 Index | 5,000 % | 20.06.2019 | 23.184 | (1.244) | (0,01) |
| CDX.EM-24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 119.266 | 1.141 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-20 Index | 5,000 % | 20.06.2018 | $ 11.232 | $ 72 | 0,00 |
| CDX.HY-21 Index | 5,000 % | 20.12.2018 | 24.288 | (319) | 0,00 |
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | 796.554 | (4.342) | (0,04) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 995.700 | 7.871 | 0,06 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 18.100 | 9 | 0,00 |
| | | | | $ 1.585 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month Canadian Bank Bill | 3,400 % | 20.06.2029 | CAD 6.300 | $ 637 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month Canadian Bank Bill | 3,500 % | 20.06.2044 | 4.000 | (605) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 17.06.2025 | $ 1.791.970 | 23.695 | 0,19 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 15.06.2046 | 642.600 | (3.784) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,000 % | 17.12.2019 | AUD 12.400 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,250 % | 15.06.2022 | 188.400 | 13.249 | 0,11 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,000 % | 15.03.2023 | 388.900 | 21.852 | 0,17 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,250 % | 11.12.2023 | 82.800 | 5.807 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,750 % | 18.06.2024 | 124.400 | 7.140 | 0,06 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.12.2024 | 197.200 | (2.042) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,250 % | 17.12.2024 | 97.200 | 4.616 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,500 % | 17.06.2025 | 361.600 | (2.582) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 2,000 % | 17.09.2024 | € 149.000 | (263) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,270 % | 05.02.2020 | MXN 180.900 | 20 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,145 % | 02.04.2020 | 82.200 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,430 % | 17.11.2021 | 413.600 | 246 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,810 % | 02.05.2022 | 189.300 | (36) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,850 % | 02.05.2022 | 761.200 | (60) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,780 % | 29.09.2022 | 579.430 | (131) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,980 % | 26.08.2024 | 87.900 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,710 % | 20.09.2029 | 87.500 | (73) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,620 % | 18.02.2030 | 94.500 | (75) | 0,00 |
| | | | | | $ 67.616 | 0,54 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 69.201** | **0,55** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | DUB | JPY 30,000 | 22.09.2016 | BRL 35.240 | $ (437) | $ (1.103) | (0,01) |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | JPM | 30,000 | 22.09.2016 | 88.130 | (1.027) | (2.758) | (0,02) |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | MSB | 30,000 | 22.09.2016 | 44.050 | (540) | (1.378) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | BRL 3,905 | 31.03.2016 | $ 69.000 | (2.058) | (4.664) | (0,04) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | MSB | 3,950 | 14.04.2016 | 84.700 | (2.490) | (5.621) | (0,04) |
| | | | | | $ (6.552) | $ (15.524) | (0,12) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BPS | $ 1.900 | $ (183) | $ (61) | $ (122) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | DUB | 1.600 | (123) | (68) | (55) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 9.200 | (706) | (393) | (313) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 5.700 | (550) | (194) | (356) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | HUS | 1.200 | (92) | (51) | (41) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2018 | BOA | 820 | (511) | (339) | (172) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.06.2017 | BPS | 1.400 | (670) | (372) | (298) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2017 | BRC | 1.000 | (546) | (325) | (221) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2017 | CBK | 400 | (219) | (132) | (87) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | 720 | (503) | (72) | (431) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | GST | 300 | (182) | (29) | (153) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.06.2019 | GST | 300 | (198) | (20) | (178) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2019 | GST | $ 300 | $ (202) | $ (44) | $ (158) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 1.200 | (839) | (137) | (702) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2017 | JPM | 500 | (257) | (11) | (246) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2017 | JPM | 300 | (164) | (93) | (71) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | JPM | 200 | (121) | (15) | (106) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2018 | JPM | 500 | (311) | (207) | (104) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | JPM | 900 | (629) | (85) | (544) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2017 | MYC | 800 | (437) | (252) | (185) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | MYC | 1.480 | (898) | (114) | (784) | (0,01) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.03.2019 | MYC | 500 | (321) | (34) | (287) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | MYC | 300 | (210) | (31) | (179) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 2.100 | (60) | (12) | (48) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 3.000 | (99) | 3 | (102) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 2.100 | (60) | (12) | (48) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 2.100 | (60) | (10) | (50) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 2.100 | (60) | (9) | (51) | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | 100 | (11) | (15) | 4 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 600 | (65) | (91) | 26 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 3.900 | (10) | (363) | 353 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 3.200 | (74) | (107) | 33 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BPS | 1.700 | (40) | (50) | 10 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 1.900 | (44) | (55) | 11 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 2.100 | (39) | (92) | 53 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 9.700 | (225) | (307) | 82 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 4.200 | (78) | (173) | 95 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | HUS | 2.600 | (60) | (80) | 20 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 2.100 | (39) | (92) | 53 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 6.300 | (146) | (210) | 64 | 0,00 |
| Navient Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | CBK | 600 | (34) | (10) | (24) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2018 | BPS | 600 | (112) | (86) | (26) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BPS | 3.900 | (969) | (248) | (721) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | BPS | 6.950 | (1.914) | (675) | (1.239) | (0,02) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | BPS | 1.300 | (375) | (217) | (158) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 2.600 | (646) | (163) | (483) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | 19.400 | (5.341) | (2.492) | (2.849) | (0,04) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 1.500 | (413) | (164) | (249) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 4.850 | (1.335) | (521) | (814) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | GST | 200 | (58) | (30) | (28) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 1.980 | (619) | (288) | (331) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | HUS | 14.060 | (3.871) | (1.410) | (2.461) | (0,03) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | HUS | 2.600 | (749) | (444) | (305) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 1.120 | (350) | (159) | (191) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | JPM | 2.940 | (809) | (271) | (538) | (0,01) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | MYC | 10.700 | (2.946) | (990) | (1.956) | (0,02) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 4.300 | (206) | (228) | 22 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 2.220 | (204) | (177) | (27) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | BOA | 6.800 | (1.097) | (648) | (449) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2024 | BOA | 2.700 | (447) | (275) | (172) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 600 | (29) | (35) | 6 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 2.600 | (140) | (161) | 21 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 10.400 | (954) | (839) | (115) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | BRC | 6.300 | (1.016) | (742) | (274) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2024 | BRC | 4.100 | (678) | (413) | (265) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 10.000 | (421) | (308) | (113) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 8.078 | (387) | (448) | 61 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | CBK | 14.900 | (801) | (923) | 122 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 14.080 | (1.292) | (1.101) | (191) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | CBK | 5.700 | (920) | (618) | (302) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2024 | CBK | 6.400 | (1.059) | (555) | (504) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 6.000 | (222) | (246) | 24 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 6.300 | (302) | (215) | (87) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 6.300 | (339) | (390) | 51 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | GST | 500 | (36) | (93) | 57 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 500 | (39) | (68) | 29 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | GST | 1.500 | (242) | (170) | (72) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2018 | HUS | 9.000 | (333) | (367) | 34 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 6.300 | (302) | (266) | (36) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | HUS | 3.640 | (196) | (149) | (47) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 7.680 | (704) | (588) | (116) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | HUS | 3.640 | (587) | (374) | (213) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2024 | HUS | 2.459 | (407) | (336) | (71) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 3.900 | (187) | (118) | (69) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 3.000 | (161) | (218) | 57 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 2.000 | (171) | (222) | 51 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 12.300 | (1.128) | (976) | (152) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | JPM | 1.700 | (274) | (156) | (118) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 1.200 | (110) | (148) | 38 | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | MYC | 3.000 | (186) | (123) | (63) | 0,00 |
| Springleaf Finance Corp. | 5,000 % | 20.09.2021 | BRC | 2.200 | 128 | 165 | (37) | 0,00 |
| Springleaf Finance Corp. | 5,000 % | 20.12.2019 | GST | 400 | 31 | 33 | (2) | 0,00 |
| Tokyo Electric Power Co., Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | JPY 250.000 | 4 | (58) | 62 | 0,00 |
| | | | | | $ (45.997) | $ (25.476) | $ (20.521) | (0,37) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ABX.HE.AA Index | 0,320 % | 25.07.2045 | BOA | $ 2.727 | $ (540) | $ (941) | $ 401 | (0,01) |
| ABX.HE.AAA Index | 0,110 % | 25.05.2046 | BOA | 111.186 | (21.321) | (23.826) | 2.505 | (0,17) |
| ABX.HE.AAA Index | 0,110 % | 25.05.2046 | BRC | 10.010 | (1.919) | (2.155) | 236 | (0,02) |
| ABX.HE.AAA Index | 0,110 % | 25.05.2046 | GST | 2.718 | (521) | (548) | 27 | 0,00 |
| CMBX.AAA-3 Index | 0,080 % | 13.12.2049 | BOA | 54.343 | (215) | (1.537) | 1.322 | 0,00 |
| CMBX.AAA-3 Index | 0,080 % | 13.12.2049 | FBF | 42.569 | (169) | (1.118) | 949 | 0,00 |
| CMBX.AAA-3 Index | 0,080 % | 13.12.2049 | MYC | 53.709 | (213) | (623) | 410 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | BOA | 30.326 | (92) | (700) | 608 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | CBK | 47.879 | (145) | (1.356) | 1.211 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | DUB | 20.677 | (62) | (715) | 653 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | FBF | 9.833 | (30) | (280) | 250 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | GST | 22.055 | (67) | (420) | 353 | 0,00 |
| CMBX.AAA-4 Index | 0,350 % | 17.02.2051 | MYC | 44.570 | (135) | (798) | 663 | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | BOA | 20.800 | (479) | (474) | (5) | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | BRC | 12.500 | (288) | (444) | 156 | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | CBK | 25.000 | (576) | (897) | 321 | (0,01) |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | DUB | 41.000 | (944) | (1.316) | 372 | (0,01) |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | FBF | 93.500 | (2.153) | (3.130) | 977 | (0,02) |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | MYC | 27.500 | (633) | (998) | 365 | (0,01) |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | UAG | 27.500 | (633) | (972) | 339 | (0,01) |
| CMBX.AAA-6 Index | 1,000 % | 11.05.2063 | BOA | 2.000 | (35) | (5) | (30) | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 1,000 % | 11.05.2063 | BRC | 21.800 | (379) | (734) | 355 | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 1,000 % | 11.05.2063 | FBF | 12.000 | (209) | (294) | 85 | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 1,000 % | 11.05.2063 | MYC | 1.200 | (21) | (37) | 16 | 0,00 |
| CMBX.AAA-7 Index | 0,500 % | 17.01.2047 | FBF | 82.300 | (2.895) | (2.842) | (53) | (0,02) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | FBF | 8.600 | (415) | (468) | 53 | 0,00 |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | GST | 50.000 | (2.411) | (2.810) | 399 | (0,02) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | MEI | 17.200 | (829) | (962) | 133 | (0,01) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | SAL | 8.600 | (415) | (471) | 56 | 0,00 |
| Primex.ARM.AAA-2 Index | 4,580 % | 25.12.2037 | BRC | 1.240 | 52 | 52 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (38.692) | $ (51.819) | $ 13.127 | (0,31) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 18.02.2021 | GLM | $ 513.700 | $ 5.499 | $ 3.114 | $ 2.385 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 18.02.2021 | JPM | 330.300 | 3.535 | 1.977 | 1.558 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,550 % | 18.02.2026 | GLM | 120.600 | 1.306 | 341 | 965 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | UAG | BRL 43.175 | (1.442) | 136 | (1.578) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,000 % | 04.01.2021 | BPS | 139.000 | (4.304) | (133) | (4.171) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | HUS | 48.550 | (1.439) | 102 | (1.541) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 38.800 | (1.081) | (51) | (1.030) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | CBK | 38.800 | (1.081) | (44) | (1.037) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | DUB | 248.900 | (6.937) | 353 | (7.290) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | FBF | 38.800 | (1.081) | (39) | (1.042) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | GLM | 38.800 | (1.081) | (46) | (1.035) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 91.500 | (2.550) | (103) | (2.447) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 62.480 | (1.523) | (38) | (1.485) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | FBF | 78.100 | (1.905) | (68) | (1.837) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | MYC | 78.100 | (1.905) | (30) | (1.875) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | BPS | 123.200 | (593) | (9) | (584) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | MYC | 28.970 | (139) | (3) | (136) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 16,400 % | 04.01.2021 | GLM | 81.720 | 16 | (109) | 125 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,250 % | 06.09.2019 | GLM | MXN 165.000 | 64 | (23) | 87 | 0,00 |
| | | | | | | $ (16.641) | $ 5.327 | $ (21.968) | (0,13) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD 117.081 | $ 84.123 | BOA | $ 0 | $ (1.059) | $ (1.059) | (0,01) |
| 01/2016 | $ 120.502 | AUD 165.814 | CBK | 136 | 0 | 136 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 48.733 | $ 35.046 | SCX | 0 | (409) | (409) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 668.297 | 170.550 | BOA | 1.628 | 0 | 1.628 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 167.577 | BRL 668.297 | BOA | 1.345 | 0 | 1.345 | 0,01 |
| 01/2016 | 413.042 | 1.612.845 | BPS | 0 | (5.371) | (5.371) | (0,04) |
| 01/2016 | BRL 1.612.845 | $ 425.371 | BPS | 17.717 | (17) | 17.700 | 0,14 |
| 01/2016 | $ 79.083 | BRL 309.333 | DUB | 0 | (894) | (894) | (0,01) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 309.333 | $ | 78.957 | DUB | $ 769 | $ 0 | $ 769 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.577 | BRL | 10.062 | JPM | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 10.062 | $ | 2.550 | JPM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 296.163 | BRL | 1.159.476 | TOR | 0 | (3.088) | (3.088) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 1.159.476 | $ | 296.805 | TOR | 3.741 | (11) | 3.730 | 0,03 |
| 01/2016 | CAD | 179.200 | | 129.083 | HUS | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| 01/2016 | | 100.000 | | 71.962 | JPM | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 421 | | 426 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.439 | | 1.563 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 145 | | 159 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 34 | € | 32 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.177 | | 5.768 | BPS | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 14.641 | $ | 15.979 | CBK | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.862 | | 2.033 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 32.046 | € | 30.010 | CBK | 559 | (5) | 554 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 203 | $ | 215 | DUB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 751.161 | | 796.103 | GLM | 42 | (19.926) | (19.884) | (0,16) |
| 01/2016 | $ | 410.916 | € | 373.918 | HUS | 0 | (4.728) | (4.728) | (0,04) |
| 01/2016 | | 782.168 | | 715.744 | JPM | 0 | (4.655) | (4.655) | (0,04) |
| 01/2016 | € | 2.023 | $ | 2.211 | JPM | 15 | (1) | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | | 349.680 | | 371.730 | MSB | 0 | (8.127) | (8.127) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 84 | € | 77 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 12.414 | $ | 13.541 | RBC | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.053 | € | 10.045 | SCX | 0 | (141) | (141) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 18.289 | $ | 19.366 | SOG | 0 | (501) | (501) | 0,00 |
| 01/2016 | | 14.207 | | 15.515 | UAG | 87 | (5) | 82 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 214.385 | | 323.892 | CBK | 7.910 | 0 | 7.910 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 322.162 | £ | 217.606 | MSB | 0 | (1.433) | (1.433) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 3.221 | $ | 4.796 | UAG | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | HKD | 1.350 | | 174 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 28.248.582 | | 230.225 | BOA | 0 | (4.603) | (4.603) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 228.558 | JPY | 27.656.881 | JPM | 1.351 | 0 | 1.351 | 0,01 |
| 01/2016 | | 4.904 | | 591.700 | SCX | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.224 | RUB | 85.668 | BOA | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 85.668 | $ | 1.190 | JPM | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| 01/2016 | SGD | 197 | | 139 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 325 | | 229 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.686 | AUD | 3.790 | BPS | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 165.814 | $ | 120.339 | CBK | 0 | (130) | (130) | 0,00 |
| 02/2016 | | 29.169 | | 20.491 | CBK | 0 | (691) | (691) | (0,01) |
| 02/2016 | | 16.675 | | 11.861 | JPM | 0 | (249) | (249) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 12.796 | AUD | 17.735 | SCX | 83 | 0 | 83 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 668.297 | $ | 165.876 | BOA | 0 | (1.331) | (1.331) | (0,01) |
| 02/2016 | | 309.333 | | 78.310 | DUB | 915 | 0 | 915 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 12.546 | BRL | 51.203 | JPM | 265 | 0 | 265 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 1.159.476 | $ | 293.271 | TOR | 3.172 | 0 | 3.172 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 1.224 | CAD | 1.630 | BOA | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 71.457 | $ | 53.457 | CBK | 2.012 | 0 | 2.012 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 1.414 | CAD | 1.941 | CBK | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | | 268.643 | | 373.003 | JPM | 209 | (307) | (98) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 481.408 | $ | 361.370 | JPM | 14.778 | 0 | 14.778 | 0,12 |
| 02/2016 | $ | 22.332 | CAD | 31.093 | MSB | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 198.840 | $ | 149.739 | MSB | 6.583 | 0 | 6.583 | 0,05 |
| 02/2016 | $ | 106.856 | CAD | 148.945 | SCX | 378 | 0 | 378 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 36 | $ | 37 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 421 | | 420 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 407.595 | | 58.897 | HUS | 0 | (498) | (498) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 373.918 | | 411.207 | HUS | 4.731 | 0 | 4.731 | 0,04 |
| 02/2016 | $ | 3.713 | € | 3.406 | JPM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 6.406 | $ | 7.007 | JPM | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 02/2016 | | 711.735 | | 778.295 | JPM | 4.589 | 0 | 4.589 | 0,04 |
| 02/2016 | £ | 16.885 | | 25.378 | BOA | 489 | 0 | 489 | 0,00 |
| 02/2016 | | 14.530 | | 21.917 | CBK | 499 | 0 | 499 | 0,00 |
| 02/2016 | | 60.730 | | 91.730 | HUS | 2.212 | 0 | 2.212 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 22.081 | £ | 14.701 | JPM | 0 | (412) | (412) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 14.744 | $ | 22.269 | JPM | 535 | 0 | 535 | 0,00 |
| 02/2016 | | 401 | | 595 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 224 | | 339 | MSB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | | 217.606 | | 322.183 | MSB | 1.428 | 0 | 1.428 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.007 | £ | 678 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 1.319 | $ | 1.996 | SCX | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 415 | HKD | 3.213 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 18.680.000 | $ | 152.543 | BOA | 0 | (2.925) | (2.925) | (0,02) |
| 02/2016 | | 231.000 | | 1.886 | CBK | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 305.565 | JPY | 36.790.000 | DUB | 460 | 0 | 460 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 27.656.881 | $ | 228.687 | JPM | 0 | (1.367) | (1.367) | (0,01) |
| 02/2016 | | 33.256.104 | | 270.275 | JPM | 0 | (6.412) | (6.412) | (0,05) |
| 02/2016 | | 1.045.757 | | 8.491 | SCX | 0 | (210) | (210) | 0,00 |
| 03/2016 | | 19.600.000 | | 160.088 | BOA | 0 | (3.067) | (3.067) | (0,02) |
| 03/2016 | | 20.840.000 | | 170.321 | BPS | 0 | (3.157) | (3.157) | (0,03) |
| 03/2016 | | 27.540.000 | | 224.756 | MSB | 0 | (4.494) | (4.494) | (0,04) |
| 03/2016 | $ | 174 | MXN | 3.006 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 96.335 | $ | 5.578 | BRC | 28 | 0 | 28 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (Wertabnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 03/2016 | $ | 547 | MXN | 9.346 | JPM | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| 03/2016 | | 13.935 | RUB | 945.709 | BOA | 0 | (1.269) | (1.269) | (0,01) |
| 03/2016 | | 9.202 | | 668.462 | FBF | 0 | (250) | (250) | 0,00 |
| 03/2016 | | 38.116 | | 2.691.445 | GLM | 0 | (2.070) | (2.070) | (0,02) |
| 03/2016 | | 33.570 | | 2.473.466 | HUS | 0 | (444) | (444) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 42.888 | $ | 12.603 | GLM | 2.093 | 0 | 2.093 | 0,02 |
| 04/2016 | | 43.188 | | 12.680 | MSB | 2.144 | 0 | 2.144 | 0,02 |
| 04/2016 | JPY | 33.040.000 | | 274.855 | BPS | 0 | (519) | (519) | 0,00 |
| 04/2016 | $ | 1.162 | RUB | 85.668 | JPM | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 70.800 | $ | 18.397 | DUB | 1.553 | 0 | 1.553 | 0,01 |
| 10/2016 | | 70.800 | | 17.990 | BRC | 1.667 | 0 | 1.667 | 0,01 |
| | | | | | | $ 86.751 | $ (85.055) | $ 1.696 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (115.158)** | **(0,92)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (k)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (243.100) | $ (243.121) | (1,94) |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 | | (64.500) | (66.551) | (0,53) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | (102.000) | (105.025) | (0,84) |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | | (91.000) | (96.301) | (0,77) |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | | (5.000) | (5.281) | (0,04) |
| | | | $ (516.279) | (4,12) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (516.279)** | **(4,12)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 12.218.349** | **97,58** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 254 | $ 375 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 174 | 174 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 4.999 | 3.637 | 0,03 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 19.286 | 160 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4.828 | 4.828 | 0,04 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 2.664 | 388 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 10 | 10 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 190 | 2 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 10 | 7 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 52 | 52 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 38 | 27 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 43 | 32 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.506 | 1.506 | 0,01 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 2 | 2 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 9 | 10 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 33 | 4 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 264 | 186 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.450 | 1.450 | 0,01 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2.931 | 2.133 | 0,02 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 354 | 255 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 9.137 | 9.926 | 0,08 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 8.123 | 68 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 80 | 118 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 34 | 34 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 25.386** | **0,20** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 277.206** | **2,22** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 12.520.941** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 16.763 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

(d) **Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

(e) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 172.439 und Barmittel in Höhe von USD 2.901 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(g) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 12.905 und Barmittel in Höhe von USD 61.217 als Sicherheiten für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(h) **Reines Kapitalwertpapier.**

(i) **Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(j) **Barmittel in Höhe von USD 2.670 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(k) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(l) **Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Oleo e Gas Participacoes S.A. | 10,000 % | 11.04.2015 | 07.04.2015 | $ 1.119 | $ 816 | 0,01 |
| Towergate Finance PLC | | | 02.04.2015 | 0 | 1.295 | 0,01 |
| | | | | $ 1.119 | $ 2.111 | 0,02 |

(m) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.057.039 | $ 11.597.964 | $ 126.405 | $ 12.781.408 |
| Finanzderivate[3] | (823) | (45.957) | 0 | (46.780) |
| Leerverkäufe | 0 | (516.279) | 0 | (516.279) |
| **Summen** | **$ 1.056.216** | **$ 11.035.728** | **$ 126.405** | **$ 12.218.349** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 873.563 | $ 7.731.862 | $ 85.015 | $ 8.690.440 |
| Finanzderivate[3] | (24) | 40.637 | 3.744 | 44.357 |
| **Summen** | **$ 873.539** | **$ 7.772.499** | **$ 88.759** | **$ 8.734.797** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(n) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class Z AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD 90 | $ 65 | AZD | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 66 | AUD 91 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 3 | $ 2 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 91 | 66 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 91 | 66 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 66 | AUD 91 | NAB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 55 | 76 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 67 | 92 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 47 | $ 34 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 65 | AUD 90 | AZD | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | 66 | 91 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 66 | 91 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 34 | 47 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 3 | $ (1) | $ 2 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Income Fund (Forts.)

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 19.369 | CHF 19.881 | BOA | $ 492 | $ (2) | $ 490 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 23 | $ 23 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 925 | CHF 937 | BPS | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 1.117 | $ 1.116 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 723 | CHF 719 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 26.986 | $ 27.300 | CBK | 341 | 0 | 341 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 25.276 | CHF 25.801 | DUB | 499 | 0 | 499 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 263 | $ 257 | FBF | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | 26.991 | 27.327 | JPM | 363 | 0 | 363 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 26.307 | CHF 26.870 | JPM | 536 | 0 | 536 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 24.446 | $ 24.680 | MSB | 260 | 0 | 260 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 5.863 | CHF 6.015 | MSB | 148 | (2) | 146 | 0,00 |
| 01/2016 | 216 | 214 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 81 | 80 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 26.991 | $ 27.325 | UAG | 361 | 0 | 361 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 25.017 | CHF 25.404 | UAG | 362 | 0 | 362 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF 232 | $ 235 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 27.335 | CHF 26.986 | CBK | 0 | (341) | (341) | 0,00 |
| 02/2016 | 27.361 | 26.991 | JPM | 0 | (363) | (363) | 0,00 |
| 02/2016 | 24.032 | 23.776 | MSB | 0 | (250) | (250) | 0,00 |
| 02/2016 | 27.356 | 26.991 | UAG | 0 | (358) | (358) | 0,00 |
| | | | | $ 3.377 | $ (1.330) | $ 2.047 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 999.849 | $ 1.098.634 | BOA | $ 12.498 | $ 0 | $ 12.498 | 0,10 |
| 01/2016 | $ 1.057.134 | € 991.688 | BOA | 20.137 | 0 | 20.137 | 0,16 |
| 01/2016 | 13.645 | 12.469 | BPS | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| 01/2016 | € 22.607 | $ 24.557 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 98.846 | € 90.929 | CBK | 379 | (449) | (70) | 0,00 |
| 01/2016 | € 7.520 | $ 8.105 | CBK | 40 | (103) | (63) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 19.891 | € 18.599 | DUB | 313 | 0 | 313 | 0,00 |
| 01/2016 | 769.983 | 726.692 | GLM | 19.422 | 0 | 19.422 | 0,16 |
| 01/2016 | € 999.849 | $ 1.098.779 | HUS | 12.643 | 0 | 12.643 | 0,10 |
| 01/2016 | $ 1.019.652 | € 956.813 | HUS | 19.734 | 0 | 19.734 | 0,16 |
| 01/2016 | € 822.194 | $ 898.466 | JPM | 5.316 | 0 | 5.316 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 2.403 | € 2.260 | NAB | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 01/2016 | 18.547 | 17.002 | RBC | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| 01/2016 | € 22.668 | $ 24.623 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 13.831 | € 12.625 | SCX | 0 | (117) | (117) | 0,00 |
| 01/2016 | 10 | 9 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.063.206 | 1.000.204 | UAG | 23.322 | (7) | 23.315 | 0,18 |
| 01/2016 | € 983.792 | $ 1.074.596 | UAG | 5.903 | 0 | 5.903 | 0,05 |
| 02/2016 | $ 1.130.865 | € 1.028.474 | BOA | 0 | (12.841) | (12.841) | (0,10) |
| 02/2016 | 1.099.557 | 999.849 | HUS | 0 | (12.651) | (12.651) | (0,10) |
| 02/2016 | 899.081 | 822.194 | JPM | 0 | (5.299) | (5.299) | (0,04) |
| 02/2016 | € 9 | $ 10 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.075.353 | € 983.792 | UAG | 0 | (5.903) | (5.903) | (0,05) |
| | | | | $ 119.759 | $ (37.551) | $ 82.208 | 0,66 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 8 | $ 12 | AZD | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 6 | 9 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 703 | £ 466 | BOA | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 01/2016 | 12.809 | 8.511 | BPS | 0 | (264) | (264) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 492 | $ 725 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 14.211 | 21.092 | CBK | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 21.228 | £ 14.051 | CBK | 0 | (517) | (517) | (0,01) |
| 01/2016 | 18.732 | 12.426 | DUB | 0 | (418) | (418) | (0,01) |
| 01/2016 | 9.596 | 6.373 | JPM | 0 | (202) | (202) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 14.019 | $ 20.804 | JPM | 141 | 0 | 141 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 18.623 | £ 12.353 | MSB | 0 | (417) | (417) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 14.019 | $ 20.755 | MSB | 92 | 0 | 92 | 0,00 |
| 01/2016 | 12.072 | 17.866 | SCX | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 15 | £ 10 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 20.712 | 13.956 | CBK | 0 | (141) | (141) | 0,00 |
| 02/2016 | 20.805 | 14.019 | JPM | 0 | (140) | (140) | 0,00 |
| 02/2016 | 20.757 | 14.019 | MSB | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| 02/2016 | 17.868 | 12.072 | SCX | 0 | (73) | (73) | 0,00 |
| 02/2016 | 133 | 89 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 453 | $ (2.281) | $ (1.828) | (0,02) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class E RMB (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 879 | CNH | 5.627 | BOA | $ 0 | $ (26) | $ (26) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 641 | $ | 99 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 577 | CNH | 3.697 | CBK | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 325 | $ | 49 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.009 | | 153 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.486 | CNH | 35.294 | JPM | 0 | (135) | (135) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 1.385 | $ | 215 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.445 | | 376 | RBC | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.485 | CNH | 35.294 | SCX | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.484 | | 35.294 | UAG | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| | | | | | | $ 13 | $ (445) | $ (432) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class, Administrative SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | SGD | 5.895 | $ | 4.157 | CBK | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 300 | SGD | 425 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 856 | | 1.203 | BOA | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.169 | $ | 828 | BRC | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.318 | SGD | 1.860 | BRC | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.217 | $ | 860 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.359 | SGD | 3.328 | CBK | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 02/2016 | | 69.432 | | 98.420 | DUB | 0 | (176) | (176) | 0,00 |
| 02/2016 | | 136.913 | | 193.136 | HUS | 0 | (1.008) | (1.008) | (0,01) |
| 02/2016 | | 360 | | 510 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 137.241 | | 193.215 | SCX | 0 | (1.281) | (1.281) | (0,01) |
| | | | | | | $ 11 | $ (2.504) | $ (2.493) | (0,02) |

**(o) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 50.827 | $ 55.470 | $ (212) | $ 0 | $ (212) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(p) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | (0,375 %) | 15.12.2015 | 15.12.2017 | $ 2.405 | $ (2.405) | (0,02) |
| BCY | 0,000 % | 11.12.2015 | 10.12.2017 | 1.096 | (1.095) | (0,01) |
| CFR | (0,750 %) | 19.11.2013 | 18.11.2017 | € 4.635 | (4.495) | (0,04) |
| CFR | (0,750 %) | 06.01.2014 | 03.01.2016 | 2.731 | (2.922) | (0,02) |
| CFR | (0,750 %) | 23.01.2014 | 21.01.2016 | 3.878 | (4.151) | (0,03) |
| SBI | (1,000 %) | 11.12.2015 | 10.12.2017 | $ 1.238 | (1.237) | (0,01) |
| | | | | | $ (16.305) | (0,13) |

**(q) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (16.970) | $ 11.993 | $ (4.977) |
| BPS | (704) | (270) | (974) |
| BRC | (10.169) | 9.988 | (181) |
| CBK | 1.757 | (150) | 1.607 |
| DUB | (8.000) | 4.927 | (3.073) |
| FBF | (9.113) | 8.841 | (272) |
| GLM | 489 | (2.120) | (1.631) |
| GST | (8.958) | 8.939 | (19) |
| HUS | 10.835 | (15.830) | (4.995) |
| JPM | 4.838 | (5.409) | (571) |
| MEI | (829) | 930 | 101 |
| MSB | (11.103) | 12.788 | 1.685 |
| MYC | (10.704) | 10.054 | (650) |
| NAB | 53 | 0 | 53 |
| RBC | (20) | 0 | (20) |
| SAL | (415) | 470 | 55 |
| SCX | (1.764) | 1.392 | (372) |
| SOG | (502) | 500 | (2) |
| TOR | 3.814 | 60 | 3.874 |
| UAG | 21.599 | (28.851) | (7.252) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(r) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 102,08 | 99,66 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,01) | 0,00 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,55 | 0,56 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,92) | (0,05) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (4,12) | 0,00 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Income Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 907.982.363 | $ 9.085.411 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ | 279.500 | 276.709 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 07.08.2015 | | 223.400 | 223.361 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 22.05.2015 | | 220.700 | 220.677 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,048 % fällig am 08.04.2015 | | 192.300 | 192.293 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.07.2015 | | 181.500 | 181.494 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 08.07.2015 | | 163.700 | 163.695 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 407.974 | 135.257 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2015 | $ | 111.800 | 111.797 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 12.08.2015 | | 82.100 | 82.090 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.06.2015 | | 69.700 | 69.691 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 14.08.2015 | | 60.300 | 60.292 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.08.2036 | | 65.701 | 50.815 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 (b) | | 49.798 | 48.327 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 43.095 | 47.338 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 14.07.2015 | | 44.900 | 44.899 |
| **Ford Credit Auto Owner Trust** | | | |
| 0,350 % fällig am 15.06.2016 | | 44.000 | 44.000 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,068 % fällig am 06.04.2015 | | 43.600 | 43.599 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,040 % fällig am 06.07.2015 | | 40.100 | 40.099 |
| **ALESCO Preferred Funding VIII Ltd.** | | | |
| 0,973 % fällig am 23.12.2035 | | 48.566 | 37.506 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 889.595.032 | $ 8.901.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 22.05.2015 | $ | 220.700 | 220.683 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,048 % fällig am 08.04.2015 | | 192.300 | 192.299 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 07.08.2015 | | 138.600 | 138.591 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,150 % fällig am 09.04.2015 | | 88.800 | 88.790 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.07.2015 | | 75.800 | 75.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.06.2015 | | 69.700 | 69.696 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2050 | BRL | 63.740 | 63.701 |
| **Programa Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos** | | | |
| 4,250 % fällig am 10.04.2031 | € | 42.800 | 61.012 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 14.08.2015 | $ | 58.500 | 58.496 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 12.08.2015 | | 52.900 | 52.896 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,082 % fällig am 24.07.2015 | | 33.500 | 33.497 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,068 % fällig am 06.04.2015 | | 21.000 | 21.000 |
| **Cantor Commercial Real Estate Co. LP** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.02.2018 | | 19.532 | 20.526 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 01.03.2025 | | 18.395 | 19.107 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 17.450 | 18.045 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,080 % fällig am 26.08.2015 | | 17.400 | 17.398 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,063 % fällig am 21.05.2015 | | 16.730 | 16.730 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | £ | 9.500 | 15.776 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 7,600 % fällig am 15.09.2039 | $ | 15.250 | 15.593 |

(a) Der Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Inflation Strategy Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 200 | $ 200 | 0,35 |
| 3,250 % fällig am 29.09.2017 | | 300 | 300 | 0,53 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 213 | 0,38 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | | 100 | 109 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 200 | 223 | 0,40 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | $ | 450 | 450 | 0,80 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 6.000 | 373 | 0,66 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | $ | 500 | 517 | 0,92 |
| **Bankia S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 17.01.2019 | € | 500 | 573 | 1,02 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 500 | 738 | 1,31 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 11.07.2024 | $ | 300 | 292 | 0,52 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 250 | 242 | 0,43 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 200 | 201 | 0,36 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 300 | 303 | 0,54 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | | 200 | 201 | 0,36 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 100 | 103 | 0,18 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 500 | 774 | 1,37 |
| **National Bank of Greece S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 07.10.2016 | € | 100 | 106 | 0,19 |
| **Nova Ljubljanska Banka dd** | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | | 300 | 332 | 0,59 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 200 | 300 | 0,53 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 300 | 315 | 0,56 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | | 500 | 505 | 0,90 |
| | | | 7.370 | 13,09 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 400 | 408 | 0,72 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | $ | 400 | 399 | 0,71 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 100 | 28 | 0,05 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.07.2017 | | 200 | 201 | 0,36 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2022 | | 600 | 591 | 1,05 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 200 | 202 | 0,36 |
| | | | 1.829 | 3,25 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2018 | | 100 | 89 | 0,16 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | $ | 100 | 75 | 0,13 |
| | | | 164 | 0,29 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 9.363 | 16,63 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)(b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2017 - 15.07.2024 | | 6.233 | 6.066 | 10,77 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 702 | 680 | 1,21 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | | 3.670 | 3.632 | 6,45 |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 | $ | 982 | $ 1.022 | 1,81 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 2.857 | 2.915 | 5,18 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 1.022 | 1.118 | 1,99 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 839 | 933 | 1,66 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | | 1.002 | 1.160 | 2,06 |
| 2,500 % fällig am 15.07.2016 - 15.01.2029 | | 1.840 | 2.053 | 3,65 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 200 | 199 | 0,35 |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 (a) | | 2.800 | 2.825 | 5,02 |
| | | | 22.603 | 40,15 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,522 % fällig am 25.03.2035 | | 100 | 94 | 0,17 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.07.2037 | | 750 | 703 | 1,25 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 1,397 % fällig am 25.05.2035 | | 91 | 86 | 0,15 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,561 % fällig am 20.04.2035 | | 7 | 7 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 3,914 % fällig am 25.07.2035 (c) | | 206 | 206 | 0,37 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,002 % fällig am 25.09.2035 | | 500 | 426 | 0,76 |
| **Grecale RMBS Srl** | | | | |
| 0,447 % fällig am 27.01.2061 | € | 316 | 338 | 0,60 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,814 % fällig am 12.06.2043 | $ | 376 | 376 | 0,67 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,712 % fällig am 25.06.2035 | | 6 | 6 | 0,01 |
| **Marche M5 Srl** | | | | |
| 0,339 % fällig am 27.10.2065 | € | 16 | 18 | 0,03 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 51 | 54 | 0,10 |
| **Marche Mutui Srl** | | | | |
| 2,189 % fällig am 27.01.2064 | | 104 | 115 | 0,20 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.08.2036 | $ | 500 | 436 | 0,77 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,502 % fällig am 25.03.2035 | | 700 | 644 | 1,14 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 4,405 % fällig am 25.07.2036 | | 17 | 17 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,563 % fällig am 25.09.2033 | | 7 | 7 | 0,01 |
| | | | 3.533 | 6,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | € | 100 | 115 | 0,20 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2044 (b) | CLP | 102.516 | 176 | 0,31 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 2.200 | 499 | 0,89 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 4.100 | 895 | 1,59 |
| **Canada Government Bond (b)(d)** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 | CAD | 567 | 478 | 0,85 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | | 214 | 197 | 0,35 |
| **Colombian TES (b)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 25.03.2033 | COP | 1.552.524 | 417 | 0,74 |
| 3,500 % fällig am 10.03.2021 | | 456.625 | 145 | 0,26 |
| 4,250 % fällig am 17.05.2017 | | 456.625 | 150 | 0,27 |
| **Denmark Government Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (b) | DKK | 7.920 | 1.186 | 2,11 |
| **France Government Bond (b)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 | € | 505 | 571 | 1,01 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 | | 100 | 112 | 0,20 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2018 | | 1.354 | 1.514 | 2,69 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 | | 206 | 301 | 0,53 |
| **Inflation-Linked Korea Treasury Bond** | | | | |
| 1,125 % fällig am 10.06.2023 (b) | KRW | 645.519 | 537 | 0,95 |
| **Israel Government CPI-Linked Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.05.2036 | ILS | 400 | 184 | 0,33 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (b)** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2032 | € | 200 | 225 | 0,40 |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 | € | 1.215 | $ 1.392 | 2,47 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | | 325 | 394 | 0,70 |
| **Japan Government CPI-Linked Bond (b)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2024 | JPY | 41.153 | 361 | 0,64 |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 | | 230.223 | 2.024 | 3,60 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (b) | MXN | 4.273 | 251 | 0,45 |
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 (b) | | 1.286 | 76 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (b) | | 34.647 | 2.210 | 3,93 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (b) | | 14.155 | 899 | 1,60 |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | | 1.441 | 84 | 0,15 |
| **New Zealand Government Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 (b) | NZD | 1.000 | 693 | 1,23 |
| 3,000 % fällig am 15.04.2020 | | 100 | 69 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 (b) | | 100 | 75 | 0,13 |
| **Republic of Germany Inflation-Linked Bond (b)** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2026 | € | 706 | 808 | 1,44 |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 | | 617 | 688 | 1,22 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.03.2026 | | 200 | 287 | 0,51 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 800 | 884 | 1,57 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 200 | 224 | 0,40 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 500 | 571 | 1,01 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 12.000 | 657 | 1,17 |
| **Spain Government Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 1,800 % fällig am 30.11.2024 (b) | € | 50 | 60 | 0,11 |
| **Sweden Inflation-Linked Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 01.06.2022 (b) | SEK | 2.200 | 280 | 0,50 |
| **Thailand Government Bond (b)** | | | | |
| 1,200 % fällig am 14.07.2021 | THB | 33.513 | 884 | 1,57 |
| 1,250 % fällig am 12.03.2028 | | 13.065 | 321 | 0,57 |
| **Turkey Government International Bond (b)** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.04.2025 | TRY | 318 | 103 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2020 | | 5.339 | 1.932 | 3,43 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked (b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 | £ | 1.285 | 2.009 | 3,57 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 114 | 270 | 0,48 |
| | | | 26.208 | 46,56 |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANCIALS** | | | | |
| **Bank of America Corp.** | | 6.703 | 113 | 0,20 |
| **Citigroup, Inc.** | | 2.083 | 108 | 0,19 |
| **Fifth Third Bancorp** | | 5.465 | 110 | 0,19 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | 1.711 | 113 | 0,20 |
| **M&T Bank Corp.** | | 886 | 107 | 0,19 |
| **PartnerRe Ltd.** | | 1.086 | 152 | 0,27 |
| **PNC Financial Services Group, Inc.** | | 1.186 | 113 | 0,20 |
| **Symetra Financial Corp.** | | 4.776 | 152 | 0,27 |
| **US Bancorp** | | 2.580 | 110 | 0,20 |
| **Wells Fargo & Co. (e)** | | 2.045 | 111 | 0,20 |
| | | | 1.189 | 2,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Precision Castparts Corp.** | | 793 | 184 | 0,33 |
| | | | 1.373 | 2,44 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **Gold Bullion Securities Ltd.** | | 2.508 | 254 | 0,45 |
| **Source Physical Gold P-ETC** | | 50.846 | 5.291 | 9,40 |
| | | | 5.545 | 9,85 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | | |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | 533 | 48 | 0,09 |
| **Apartment Investment & Management Co. (e)** | | 1.969 | 79 | 0,14 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | 821 | 151 | 0,27 |
| **Boston Properties, Inc.** | | 1.086 | 139 | 0,25 |
| **Camden Property Trust** | | 1.938 | 149 | 0,26 |
| **DCT Industrial Trust, Inc.** | | 2.600 | 97 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Digital Realty Trust, Inc. | 851 | $ 64 | 0,12 |
| EastGroup Properties, Inc. | 846 | 47 | 0,08 |
| Equity Residential | 2.023 | 165 | 0,29 |
| Essex Property Trust, Inc. | 702 | 168 | 0,30 |
| Extra Space Storage, Inc. | 1.038 | 92 | 0,16 |
| Federal Realty Investment Trust | 675 | 99 | 0,18 |
| First Industrial Realty Trust, Inc. | 2.191 | 48 | 0,09 |
| General Growth Properties, Inc. | 2.880 | 78 | 0,14 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 3.772 | 58 | 0,10 |
| Kilroy Realty Corp. | 735 | 47 | 0,08 |
| LaSalle Hotel Properties | 1.768 | 44 | 0,08 |
| Macerich Co. | 935 | $ 75 | 0,13 |
| Pennsylvania Real Estate Investment Trust | 2.895 | 63 | 0,11 |
| Prologis, Inc. | 3.407 | 146 | 0,26 |
| Public Storage | 775 | 192 | 0,34 |
| Simon Property Group, Inc. | 1.048 | 204 | 0,36 |
| SL Green Realty Corp. | 417 | 47 | 0,08 |
| Sunstone Hotel Investors, Inc. (e) | 5.189 | 65 | 0,12 |
| UDR, Inc. | 3.372 | 127 | 0,23 |
| | | 2.492 | 4,43 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (f)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 21.895 | $ 219 | 0,39 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 71.336** | **126,72** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro STOXX 50 March Futures | Long | 03/2016 | 29 | $ 4 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 15 | 37 | 0,06 |
| H-Shares IDX January Futures | Long | 01/2016 | 4 | (7) | (0,01) |
| JPX-Nikkei 400 Index March Futures | Long | 03/2016 | 81 | (15) | (0,03) |
| Mini MSCI Emerging Markets Index March Futures | Long | 03/2016 | 21 | 25 | 0,04 |
| S&P 500 E-mini Index March Futures | Short | 03/2016 | 51 | (50) | (0,09) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 24 | (7) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 9 | 0 | 0,00 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 48 | 50 | 0,09 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 5 | 4 | 0,01 |
| | | | | $ 41 | 0,07 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,500 | 21.12.2016 | 29 | $ 3 | $ 2 | 0,01 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - 3-Month LIBOR Sterling December Futures | £ 98,000 | 21.12.2016 | 29 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 43** | **0,08** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 300 | $ 1 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 15.100 | $ 29 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 2.100 | 23 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 2.300 | 29 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,233 % | 16.09.2025 | 500 | (5) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 3.300 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 5.900 | 20 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,570 % | 10.02.2046 | 500 | 11 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 15.06.2046 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 14.12.2046 | 100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 3.700 | 7 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 930 | (30) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 20.03.2024 | JPY 160.000 | 21 | 0,04 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Inflation Strategy Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | IBMEXID | 5,780 % | 06.10.2022 | MXN 1.100 | $ 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,910 % | 25.11.2022 | 4.500 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ 103 | 0,18 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 104** | **0,18** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ZINSSWAPOPTIONEN | | | | | | | | | |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 11.04.2016 | $ 12.700 | $ 11 | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 % | 05.12.2016 | 1.100 | 8 | 5 | 0,01 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,950 % | 05.01.2016 | 5.400 | 3 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 29.04.2016 | 5.100 | 4 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 26 | $ 6 | 0,01 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE | | | | | | | |
| Put - Euro STOXX 50 Index | JPM | € 3.378,790 | 18.11.2016 | 484 | $ 21 | $ 10 | 0,02 |
| Put - S&P 500 Index | DUB | $ 1.957,950 | 18.11.2016 | 873 | 22 | 14 | 0,02 |
| | | | | | $ 43 | $ 24 | 0,04 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CREDIT DEFAULT SWAPTIONS | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | $ 100 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 100 | (1) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1) | $ 0 | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DEVISENOPTIONEN | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 17.03.2016 | $ 300 | $ (13) | $ (15) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ZINSSWAPOPTIONEN | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 05.12.2016 | $ 1.100 | $ (9) | $ (7) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 19.01.2016 | 1.000 | (4) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,000 % | 19.01.2016 | 1.000 | (4) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 18.02.2016 | 5.100 | (16) | (8) | (0,02) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,400 % | 14.03.2016 | 3.600 | (13) | (5) | (0,01) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 % | 25.01.2016 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (46) | $ (21) | (0,04) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| OPTIONEN AUF INDIZES | | | | | | | |
| Put - S&P 500 Index | DEU | $ 1.925,000 | 15.01.2016 | 3 | $ (4) | $ (1) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATION CAPS** | | | | | | | | |
| OTC CPURNSA Index | GLM | € 120,716 | Maximal [(Index Final/Index Initial)-(1+3,000 %)*20, 0,000 %] | 22.06.2035 | € 300 | $ (14) | $ (8) | (0,02) |
| OTC CPURNSA Index | DUB | $ 243,203 | Maximal [0,000 % - (Referenzindex Final/Referenzindex Initial -1) - 3,000 %] | 01.06.2016 | $ 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| OTC CPURNSA Index | JPM | 240,718 | Maximal [0,000 %, Referenzindex Final / Referenzindex Initial-1) - 3,000 %] | 10.04.2020 | 700 | 0 | 4 | 0,01 |
| | | | | | | $ (14) | $ (4) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| OTC CPURNSA Index | JPM | $ 234,812 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 24.03.2020 | $ 800 | $ (9) | $ (11) | (0,02) |
| OTC CPURNSA Index | JPM | 233,707 | Maximal [0,000 % - (Referenzindex Final / Referenzindex Initial) - 1, 0] | 10.04.2020 | 700 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (9) | $ (11) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | $ 200 | $ (140) | $ (19) | $ (121) | (0,25) |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 100 | (36) | (17) | (19) | (0,06) |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 200 | (1) | (13) | 12 | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 100 | 0 | (7) | 7 | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 500 | 6 | (9) | 15 | 0,01 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 300 | 4 | (2) | 6 | 0,01 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 200 | 2 | (2) | 4 | 0,00 |
| | | | | | $ (165) | $ (69) | $ (96) | (0,29) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 5-Year French CPI Ex Tobacco Daily Reference Index | 1,675 % | 15.06.2025 | CBK | € 100 | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | DUB | BRL 3.800 | (67) | (6) | (61) | (0,12) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | UAG | 4.000 | (65) | 0 | (65) | (0,12) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,030 % | 02.01.2018 | BRC | 2.000 | (25) | 0 | (25) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | JPM | 5.500 | (55) | (10) | (45) | (0,10) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,500 % | 04.01.2021 | BPS | 1.000 | (12) | 0 | (12) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,560 % | 04.01.2021 | BPS | 1.400 | (16) | 0 | (16) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,560 % | 04.01.2021 | FBF | 1.200 | (14) | 0 | (14) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,710 % | 04.01.2021 | HUS | 2.400 | (10) | 0 | (10) | (0,02) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,525 % | 15.10.2017 | UAG | € 300 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,540 % | 15.10.2017 | BRC | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,550 % | 15.10.2017 | BPS | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | DUB | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,580 % | 15.10.2017 | JPM | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,600 % | 15.08.2018 | BRC | 1.200 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,655 % | 15.08.2018 | CBK | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,605 % | 15.09.2018 | DUB | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,610 % | 15.09.2018 | UAG | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,650 % | 15.10.2018 | DUB | 300 | 0 | 1 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,680 % | 15.10.2018 | SOG | 200 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 480 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,190 % | 15.04.2030 | CBK | 400 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,320 % | 15.05.2030 | MYC | 200 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Inflation Strategy Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | BRC | £ 400 | $ 18 | $ 0 | $ 18 | 0,03 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.05.2030 | CBK | 200 | 9 | 0 | 9 | 0,02 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | BRC | 200 | 5 | (2) | 7 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,325 % | 15.08.2030 | GLM | 200 | 5 | (1) | 6 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,350 % | 15.08.2030 | BOA | 1.100 | 35 | (4) | 39 | 0,06 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,335 % | 15.04.2035 | FBF | 300 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,358 % | 15.04.2035 | GLM | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,550 % | 05.11.2016 | RYL | $ 1.200 | (24) | 0 | (24) | (0,04) |
| Zahlung | US CPI Urban Consumers NSA | 2,058 % | 12.05.2025 | MYC | 400 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,730 % | 26.08.2025 | BOA | 300 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | | | | | | $ (186) | $ (23) | $ (163) | (0,33) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF ROHSTOFFE

| Zahlung/Erhalt Referenzeinheit | Referenzeinheit | (Zahlung)/Erhalt fester Kurs je Einheit | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Anzahl der Einheiten | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total Return Index | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | BPS | 5.071 | $ 20 | $ 0 | $ 20 | 0,03 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total Return Index | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | CBK | 5.657 | 20 | 1 | 19 | 0,04 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total Return Index | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | GLM | 2.682 | 9 | 0 | 9 | 0,02 |
| Zahlung | Bloomberg Commodity Total Return Index | 3-Month US Treasury Bills zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.02.2016 | JPM | 15.942 | 58 | 0 | 58 | 0,10 |
| | | | | | | $ 107 | $ 1 | $ 106 | 0,19 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | NAREIT Developed Index | 3.842 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 15.224 | 29.02.2016 | DUB | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Erhalt | S&P Bank Select Industry TR Index | 293 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 297 | 31.10.2016 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## VARIANZ-SWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Basiswerte | Ausübungskurs | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Nikkei 225 Index | 0,001 % | 09.12.2016 | SOG | JPY 533.346 | $ 23 | $ 0 | $ 23 | 0,04 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD 85 | $ 62 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 106 | BRL 424 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 424 | $ 108 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 316 | 80 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 83 | BRL 316 | BPS | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | 199 | 776 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 776 | $ 232 | CBK | 36 | 0 | 36 | 0,06 |
| 01/2016 | 22.700 | 5.793 | DUB | 56 | 0 | 56 | 0,10 |
| 01/2016 | $ 6.010 | BRL 22.700 | DUB | 0 | (272) | (272) | (0,48) |
| 01/2016 | 3 | 13 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL 13 | $ 3 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 589 | CAD 800 | CBK | 0 | (13) | (13) | (0,02) |
| 01/2016 | 103 | 140 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD 944 | $ 708 | JPM | 29 | 0 | 29 | 0,05 |
| 01/2016 | $ 580 | CAD 804 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK 8.350 | $ 1.187 | HUS | 0 | (29) | (29) | (0,05) |
| 01/2016 | $ 10.187 | € 9.271 | BOA | 0 | (116) | (116) | (0,21) |
| 01/2016 | € 15 | $ 16 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 99 | € 91 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 266 | $ 289 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 9.651 | 10.285 | HUS | 0 | (199) | (199) | (0,35) |
| 01/2016 | $ 609 | € 555 | JPM | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | € 26 | $ 28 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 24 | 26 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 4.275 | £ | 2.881 | JPM | $ 0 | $ (29) | $ (29) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 2.973 | $ | 4.482 | MSB | 100 | 0 | 100 | 0,18 |
| 01/2016 | $ | 237 | £ | 157 | UAG | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 65 | $ | 99 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 87 | ILS | 340 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 296.500 | $ | 2.428 | GLM | 0 | (37) | (37) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 2.450 | JPY | 296.500 | MSB | 14 | 0 | 14 | 0,03 |
| 01/2016 | | 226 | KRW | 266.092 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 121 | $ | 29 | FBF | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 83 | NZD | 124 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 1.385 | $ | 905 | SCX | 0 | (43) | (43) | (0,08) |
| 01/2016 | $ | 33 | RUB | 2.301 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 2.301 | $ | 35 | SOG | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | SEK | 2.605 | | 300 | BOA | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| 01/2016 | TRY | 94 | | 32 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 493 | TRY | 1.439 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 1.926 | $ | 648 | JPM | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 110 | ZAR | 1.716 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 424 | $ | 105 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.982 | | 493 | BRC | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 5.615 | BRL | 22.219 | DUB | 0 | (56) | (56) | (0,10) |
| 02/2016 | BRL | 4.162 | $ | 1.036 | FBF | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.444 | | 361 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.316 | BRL | 9.313 | JPM | 14 | 0 | 14 | 0,02 |
| 02/2016 | CAD | 804 | $ | 580 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 88 | COP | 282.040 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | COP | 482.444 | $ | 164 | HUS | 13 | 0 | 13 | 0,02 |
| 02/2016 | $ | 106 | COP | 336.341 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 9.271 | $ | 10.194 | BOA | 116 | 0 | 116 | 0,21 |
| 02/2016 | $ | 141 | € | 128 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 2.881 | $ | 4.275 | JPM | 29 | 0 | 29 | 0,05 |
| 02/2016 | HKD | 3.891 | | 502 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 471 | ILS | 1.829 | DUB | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 717 | $ | 184 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 774 | INR | 52.311 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 02/2016 | JPY | 296.500 | $ | 2.452 | MSB | 0 | (14) | (14) | (0,03) |
| 02/2016 | SGD | 340 | | 241 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 44.922 | | 1.251 | BOA | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 02/2016 | TWD | 10.323 | | 316 | GLM | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 63 | MXN | 1.085 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 29.884 | $ | 1.714 | CBK | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| 03/2016 | | 6.505 | | 379 | GLM | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 384 | MXN | 6.669 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | PLN | 48 | $ | 12 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 15.318 | | 4.750 | JPM | 996 | 0 | 996 | 1,77 |
| 04/2016 | $ | 444 | CLP | 315.924 | BPS | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 04/2016 | | 66 | | 47.504 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | | 80 | | 57.105 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 2.301 | $ | 32 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 05/2016 | $ | 138 | ZAR | 2.066 | BOA | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| 10/2016 | BRL | 700 | $ | 178 | BOA | 16 | 0 | 16 | 0,03 |
| 10/2016 | | 300 | | 72 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 10/2016 | | 200 | | 48 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 10/2016 | | 1.000 | | 249 | JPM | 19 | 0 | 19 | 0,03 |
| 10/2016 | CNH | 1.751 | | 271 | SCX | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| 10/2016 | $ | 68 | CNH | 443 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2017 | BRL | 600 | $ | 138 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2017 | | 700 | | 162 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2017 | | 1.400 | | 328 | GLM | 13 | 0 | 13 | 0,02 |
| 01/2017 | | 1.400 | | 329 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,03 |
| | | | | | | $ 1.533 | $ (882) | $ 651 | 1,16 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 408** | **0,73** |
| **Summe Anlagen** | **$ 71.891** | **127,71** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 129 | $ 190 | 0,34 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 13 | 13 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 6 | 4 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2.415 | 20 | 0,04 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 347 | 347 | 0,62 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 119 | 17 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 2 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 24 | $ 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,01 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 108 | 108 | 0,19 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 197 | 26 | 0,05 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 3 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 104 | 104 | 0,18 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 59 | 64 | 0,11 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1.017 | 9 | 0,01 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 41 | 60 | 0,11 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 3 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 970** | **1,72** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (16.568)** | **(29,43)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 56.293** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 16.736 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(c) Das Wertpapier ist in Verzug.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 674 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.

(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert in Höhe von USD 161 wurden als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Optionsgeschäfte regeln, zum 31. Dezember 2015 verpfändet.

(f) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 270 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.

(h) Barmittel in Höhe von USD 450 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(i) Barmittel in Höhe von USD 663 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.

(j) Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 9.629 | $ 61.707 | $ 0 | $ 71.336 |
| Finanzderivate[3] | 43 | 465 | 47 | 555 |
| **Summen** | **$ 9.672** | **$ 62.172** | **$ 47** | **$ 71.891** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 7.011 | $ 77.865 | $ 0 | $ 84.876 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.502 | 0 | 1.502 |
| Finanzderivate[3] | 112 | (73) | 0 | 39 |
| Leerverkäufe | 0 | (5.213) | 0 | (5.213) |
| **Summen** | **$ 7.123** | **$ 74.081** | **$ 0** | **$ 81.204** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(k) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Partially Hedged) Class, Investor EUR (Partially Hedged) Class und Class E EUR (Partially Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 2 | AUD | 3 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 2 | $ | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 264 | AUD | 364 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 365 | $ | 262 | NAB | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2 | | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | AUD | 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 1 | $ | 1 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 204 | | 153 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 52 | | 51 | FBF | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.771 | | 4.140 | BOA | 46 | (3) | 43 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 4.060 | € | 3.808 | BOA | 76 | 0 | 76 | 0,14 |
| 01/2016 | € | 27 | $ | 30 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 422 | | 448 | CBK | 0 | (10) | (10) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 210 | € | 194 | CBK | 2 | (1) | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.047 | | 3.798 | HUS | 78 | 0 | 78 | 0,14 |
| 01/2016 | € | 3.674 | $ | 4.037 | HUS | 46 | 0 | 46 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 6 | € | 6 | NAB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 33 | | 30 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 11 | $ | 12 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.236 | € | 3.983 | UAG | 90 | 0 | 90 | 0,16 |
| 01/2016 | € | 3.781 | $ | 4.130 | UAG | 23 | 0 | 23 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 2 | £ | 1 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1 | $ | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 2 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 223 | | 337 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 332 | £ | 224 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | HKD | 3 | $ | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5 | | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 141 | | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7 | JPY | 812 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1 | | 82 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 472 | $ | 4 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50 | | 0 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 64.860 | | 531 | GLM | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 536 | JPY | 64.809 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 165 | $ | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 289 | | 2 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 0 | JPY | 42 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 548 | $ | 63 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 364 | | 264 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.042 | € | 3.676 | BOA | 0 | (46) | (46) | (0,08) |
| 02/2016 | | 4.040 | | 3.674 | HUS | 0 | (46) | (46) | (0,08) |
| 02/2016 | $ | 3.995 | € | 3.654 | UAG | 0 | (22) | (22) | (0,04) |
| 02/2016 | £ | 224 | $ | 332 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 9 | | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | HKD | 7 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 3 | $ | 0 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 87 | HKD | 673 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 4 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.210 | | 414 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 16 | | 2 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 16 | | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 79 | | 1 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 64.809 | | 536 | MSB | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 127 | | 90 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 380 | $ (146) | $ 234 | 0,42 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Partially Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 95 | AUD | 131 | JPM | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 131 | $ | 94 | NAB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 55 | | 41 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 16 | | 16 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 153 | € | 139 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | € | 3 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 137 | | 146 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 132 | £ | 89 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 136 | $ | 204 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.693 | £ | 1.125 | BPS | 0 | (35) | (35) | (0,06) |
| 01/2016 | | 66 | | 45 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 1.102 | $ | 1.636 | CBK | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1.638 | £ | 1.084 | CBK | 0 | (40) | (40) | (0,07) |
| 01/2016 | | 1.703 | | 1.130 | DUB | 0 | (38) | (38) | (0,06) |
| 01/2016 | | 164 | | 109 | HUS | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 1.069 | $ | 1.587 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 01/2016 | | 1.069 | | 1.583 | SCX | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 5 | JPY | 586 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 176 | $ | 1 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | JPY | 182 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 133 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 24.709 | | 202 | GLM | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 203 | JPY | 24.592 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 169 | $ | 20 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 131 | | 95 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 136 | | 150 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.577 | £ | 1.062 | CBK | 0 | (11) | (11) | (0,02) |
| 02/2016 | | 1.587 | | 1.069 | JPM | 0 | (11) | (11) | (0,02) |
| 02/2016 | | 1.583 | | 1.069 | SCX | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | HKD | 1.045 | $ | 135 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 24.592 | | 203 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 64 | | 46 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 39 | $ (155) | $ (116) | (0,21) |

**(l) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Partially Hedged) Class, Investor EUR (Partially Hedged) Class und Class E EUR (Partially Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 190 | $ 207 | $ (1) | $ 0 | $ (1) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(m) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,450 % | 07.10.2015 | 07.04.2016 | $ 1.066 | $ (1.067) | (1,90) |
| BOS | 0,650 % | 24.11.2015 | 25.01.2016 | 1.953 | (1.954) | (3,47) |
| BOS | 0,700 % | 27.11.2015 | 08.01.2016 | 7.080 | (7.085) | (12,59) |
| BOS | 0,750 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | 1.426 | (1.427) | (2,53) |
| GRE | 0,520 % | 09.11.2015 | 11.01.2016 | 2.839 | (2.841) | (5,05) |
| GRE | 0,580 % | 16.11.2015 | 15.01.2016 | 1.108 | (1.109) | (1,97) |
| GRE | 1,000 % | 11.12.2015 | 15.01.2016 | 786 | (786) | (1,40) |
| GRE | 1,000 % | 31.12.2015 | 07.01.2016 | 690 | (689) | (1,22) |
| | | | | | $ (16.958) | (30,13) |

**(n) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten ausRückkauf-Finanzierungs-geschäften[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| TDM | 0,630 % | 09.12.2015 | 11.01.2016 | CAD 931 | $ (671) | (1,19) |

**(o) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 134 | $ 0 | $ 134 |
| BPS | (80) | 0 | (80) |
| CBK | 12 | 0 | 12 |
| DEU | (1) | 0 | (1) |
| DUB | (359) | (1.680) | (2.039) |
| FBF | (35) | 0 | (35) |
| GLM | (29) | 0 | (29) |
| GST | (141) | 0 | (141) |
| HUS | (152) | 270 | 118 |
| JPM | 1.062 | (1.070) | (8) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| MSB | $ 108 | $ 0 | $ 108 |
| MYC | 15 | 0 | 15 |
| NAB | (4) | 0 | (4) |
| RYL | (24) | 0 | (24) |
| SCX | (27) | 0 | (27) |
| SOG | 26 | 0 | 26 |
| UAG | 20 | 0 | 20 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(p) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 126,72 | 120,23 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,08 | 0,16 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,18 | (0,84) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,73 | 0,73 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (7,38) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 2,13 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Inflation Strategy Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 5.956.231 | $ 59.603 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 11.200 | 11.430 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 8.579 | 8.451 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 8.410 | 7.827 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 7.579 | 7.586 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | 7.633 | 7.503 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 5.837 | 6.861 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.05.2022 | | 6.000 | 5.912 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,250 % fällig am 30.04.2021 | | 5.500 | 5.736 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 5.471 | 5.488 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 20.900 | 5.392 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | $ | 4.957 | 5.099 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | | 4.570 | 4.561 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 3.900 | 3.888 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 3.840 | 3.822 |
| | | **AKTIEN** | |
| Gold Bullion Securities Ltd. | | 32.122 | 3.808 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Mexico Government International Bond | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 | MXN | 53.247 | 3.706 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b) | $ | 3.668 | 3.705 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 13.160 | 3.081 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 3.100 | 3.069 |
| Japan Government CPI-Linked Bond | | | |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 (b) | JPY | 328.490 | 2.928 |
| Turkey Government International Bond | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2020 | TRY | 7.227 | 2.848 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 1.700 | 2.824 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 5.975.983 | $ 59.800 |
| | | **PAR (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 13.500 | 13.628 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,250 % fällig am 30.04.2021 | | 11.000 | 11.468 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | | 11.070 | 11.371 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 9.957 | 10.130 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 8.583 | 8.444 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 8.410 | 7.478 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | 6.941 | 6.796 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 5.872 | 6.763 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.05.2022 | | 6.000 | 5.931 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 19.300 | 5.084 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 4.789 | 4.799 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | | 4.595 | 4.661 |
| | | **AKTIEN** | |
| Gold Bullion Securities Ltd. | | 40.912 | 4.588 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | $ | 4.570 | 4.567 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | | 3.900 | 3.900 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 3.840 | 3.847 |
| Republic of Germany Inflation-Linked Bond | | | |
| 0,750 % fällig am 15.04.2018 (b) | € | 2.778 | 3.247 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 | | 2.412 | 3.117 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 3.100 | 3.070 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 | € | 2.380 | 2.963 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2015 | BRL | 7.410 | 2.485 |

(a) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | | 2.779.516 | $ 27.795 | 1,80 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 1,123 % fällig am 28.10.2016 | $ | 8.000 | 8.023 | 0,52 |
| 1,800 % fällig am 04.06.2018 | | 4.300 | 4.269 | 0,28 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 500 | 516 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2017 | | 3.900 | 4.100 | 0,27 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 7.100 | 7.026 | 0,45 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,221 % fällig am 11.04.2017 | | 2.000 | 1.978 | 0,13 |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 2.100 | 2.099 | 0,14 |
| **Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 4,125 % fällig am 27.04.2017 | | 12.000 | 12.150 | 0,79 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,879 % fällig am 02.05.2017 | | 1.200 | 1.189 | 0,08 |
| 1,272 % fällig am 15.09.2026 | | 1.500 | 1.293 | 0,08 |
| 2,650 % fällig am 01.04.2019 | | 2.000 | 2.006 | 0,13 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | | 3.800 | 4.088 | 0,26 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,812 % fällig am 15.06.2017 | | 23.900 | 23.716 | 1,54 |
| **BB&T Corp.** | | | | |
| 1,036 % fällig am 15.01.2020 | | 4.900 | 4.862 | 0,31 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 4,650 % fällig am 02.07.2018 | | 4.200 | 4.486 | 0,29 |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 2.400 | 2.648 | 0,17 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,934 % fällig am 18.11.2016 | | 16.700 | 16.707 | 1,08 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | | 7.200 | 7.380 | 0,48 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,747 % fällig am 09.06.2016 | | 3.125 | 3.116 | 0,20 |
| **Citizens Bank N.A.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 03.12.2018 | | 2.900 | 2.899 | 0,19 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.11.2018 | | 1.200 | 1.192 | 0,08 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,121 % fällig am 15.04.2019 | | 1.000 | 995 | 0,06 |
| 1,457 % fällig am 10.06.2020 | | 9.400 | 9.403 | 0,61 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | £ | 14.600 | 21.517 | 1,39 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 0,720 % fällig am 28.07.2016 | JPY | 200.000 | 1.657 | 0,11 |
| 1,570 % fällig am 14.02.2018 | | 500.000 | 4.118 | 0,27 |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | $ | 11.000 | 11.015 | 0,71 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | | 2.100 | 2.128 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 4.100 | 4.274 | 0,28 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,061 % fällig am 04.06.2017 | | 19.350 | 19.302 | 1,25 |
| 1,462 % fällig am 15.11.2018 | | 1.500 | 1.507 | 0,10 |
| 1,522 % fällig am 30.04.2018 | | 3.500 | 3.518 | 0,23 |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 4.000 | 4.013 | 0,26 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2020 | | 2.000 | 2.262 | 0,15 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | | 3.200 | 3.193 | 0,21 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 1,002 % fällig am 15.05.2018 | | 1.075 | 1.072 | 0,07 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | | 12.936 | 12.914 | 0,84 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 0,969 % fällig am 13.11.2019 | | 5.000 | 4.930 | 0,32 |
| 2,375 % fällig am 13.11.2019 | | 800 | 797 | 0,05 |
| **Industrial Bank of Korea** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.07.2017 | | 700 | 705 | 0,04 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,050 % fällig am 17.08.2018 | | 4.000 | 3.998 | 0,26 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | $ | 900 | $ 926 | 0,06 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 8.300 | 8.304 | 0,54 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | | 9.590 | 10.256 | 0,66 |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.04.2018 | | 325 | 324 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 03.11.2016 | | 1.300 | 1.326 | 0,09 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 1,198 % fällig am 27.01.2017 | | 10.550 | 10.587 | 0,69 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2018 | | 200 | 197 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 23.10.2017 | | 900 | 903 | 0,06 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 0,912 % fällig am 14.05.2018 | | 7.700 | 7.649 | 0,50 |
| 2,000 % fällig am 17.08.2018 | | 6.600 | 6.609 | 0,43 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 1,444 % fällig am 29.07.2020 | | 8.600 | 8.620 | 0,56 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 1,600 % fällig am 25.04.2018 | | 6.500 | 6.573 | 0,43 |
| 2,125 % fällig am 25.04.2018 | | 900 | 902 | 0,06 |
| **MUFG Union Bank N.A.** | | | | |
| 0,734 % fällig am 05.05.2017 | | 7.700 | 7.666 | 0,50 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | | 2.700 | 2.531 | 0,16 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 1,366 % fällig am 17.09.2018 | | 1.000 | 1.004 | 0,06 |
| **Piper Jaffray Cos** | | | | |
| 5,060 % fällig am 09.10.2018 | | 1.000 | 998 | 0,06 |
| **Pricoa Global Funding I** | | | | |
| 1,350 % fällig am 18.08.2017 | | 2.500 | 2.484 | 0,16 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | | 7.700 | 8.951 | 0,58 |
| **Santander Bank N.A.** | | | | |
| 1,251 % fällig am 12.01.2018 | | 6.200 | 6.159 | 0,40 |
| **Shinhan Bank** | | | | |
| 0,968 % fällig am 08.04.2017 | | 10.000 | 9.997 | 0,65 |
| **SteelRiver Transmission Co. LLC** | | | | |
| 4,710 % fällig am 30.06.2017 | | 2.521 | 2.585 | 0,17 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 1,564 % fällig am 03.02.2020 | | 5.100 | 5.024 | 0,33 |
| **UBS AG** | | | | |
| 0,974 % fällig am 01.06.2017 | | 5.500 | 5.491 | 0,36 |
| **Wachovia Corp.** | | | | |
| 0,691 % fällig am 15.10.2016 | | 2.800 | 2.795 | 0,18 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.09.2017 | | 900 | 893 | 0,06 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.01.2019 | | 10.400 | 10.463 | 0,68 |
| | | | 359.278 | 23,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | | 1.500 | 1.506 | 0,10 |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 | | 4.600 | 4.621 | 0,30 |
| **Actavis, Inc.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 01.10.2017 | | 2.400 | 2.398 | 0,16 |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.07.2020 | | 4.200 | 4.146 | 0,27 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2017 | | 1.000 | 1.006 | 0,07 |
| 2,200 % fällig am 22.05.2019 | | 5.080 | 5.078 | 0,33 |
| 6,150 % fällig am 01.06.2018 | | 1.000 | 1.098 | 0,07 |
| **Barrick Gold Corp.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 01.04.2019 | | 130 | 133 | 0,01 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,022 % fällig am 15.06.2018 | | 9.300 | 9.293 | 0,60 |
| 1,850 % fällig am 15.06.2018 | | 1.600 | 1.600 | 0,10 |
| **Becton Dickinson & Co.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 15.12.2017 | | 2.000 | 1.998 | 0,13 |
| 2,675 % fällig am 15.12.2019 | | 900 | 906 | 0,06 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.05.2020 | | 500 | 498 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 12.01.2017 | | 1.500 | 1.548 | 0,10 |
| **Canadian Natural Resources Ltd.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 30.03.2016 | $ | 1.500 | $ 1.497 | 0,10 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2018 | | 1.100 | 1.070 | 0,07 |
| **Caterpillar Financial Services Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.12.2019 | | 1.000 | 1.003 | 0,07 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 3.700 | 3.681 | 0,24 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 600 | 599 | 0,04 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 16.04.2016 | | 5.900 | 5.899 | 0,38 |
| **ConocoPhillips Co.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 15.05.2022 | | 3.200 | 3.157 | 0,20 |
| **Cox Communications, Inc.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.01.2019 | | 510 | 591 | 0,04 |
| **Daimler Finance N.A. LLC** | | | | |
| 1,009 % fällig am 01.08.2016 | | 13.600 | 13.595 | 0,88 |
| 1,250 % fällig am 11.01.2016 | | 265 | 265 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 03.08.2018 | | 6.000 | 5.962 | 0,39 |
| 2,375 % fällig am 01.08.2018 | | 500 | 501 | 0,03 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 2.000 | 2.007 | 0,13 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,412 % fällig am 15.06.2018 | | 7.300 | 7.215 | 0,47 |
| 4,207 % fällig am 15.04.2016 | | 5.600 | 5.645 | 0,37 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2018 | | 1.295 | 1.361 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 900 | 995 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2017 | | 1.500 | 1.599 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2016 | | 6.700 | 7.086 | 0,46 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 14.11.2017 | | 1.200 | 1.028 | 0,07 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.10.2018 | | 2.000 | 2.025 | 0,13 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 1,681 % fällig am 10.04.2018 | | 2.600 | 2.582 | 0,17 |
| 1,881 % fällig am 15.01.2020 | | 6.700 | 6.599 | 0,43 |
| 2,388 % fällig am 15.01.2019 | | 1.500 | 1.509 | 0,10 |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 3.700 | 3.711 | 0,24 |
| 3,000 % fällig am 25.09.2017 | | 4.700 | 4.720 | 0,31 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 2,539 % fällig am 15.11.2019 | | 4.800 | 4.777 | 0,31 |
| **Gilead Sciences, Inc.** | | | | |
| 1,850 % fällig am 04.09.2018 | | 900 | 904 | 0,06 |
| 2,350 % fällig am 01.02.2020 | | 700 | 701 | 0,05 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.03.2017 | | 325 | 330 | 0,02 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 8.600 | 8.688 | 0,56 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 2,353 % fällig am 05.10.2017 | $ | 3.500 | 3.507 | 0,23 |
| 2,450 % fällig am 05.10.2017 | | 5.200 | 5.198 | 0,34 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 7,200 % fällig am 15.06.2018 | | 1.190 | 1.332 | 0,09 |
| **Hutchison Whampoa International 14 Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 31.10.2017 | | 6.500 | 6.451 | 0,42 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,450 % fällig am 06.02.2017 | | 500 | 498 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 09.08.2016 | | 1.800 | 1.803 | 0,12 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.07.2016 | | 700 | 710 | 0,05 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 2,050 % fällig am 11.02.2018 | | 2.500 | 2.490 | 0,16 |
| **Intel Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.07.2020 | | 800 | 810 | 0,05 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 01.12.2019 | | 3.900 | 3.613 | 0,23 |
| 7,000 % fällig am 15.06.2017 | | 1.300 | 1.340 | 0,09 |
| 7,250 % fällig am 01.06.2018 | | 400 | 416 | 0,03 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.11.2017 | | 500 | 500 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2019 | | 150 | 152 | 0,01 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 27.10.2016 | | 6.700 | 6.838 | 0,44 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 3.000 | 2.988 | 0,19 |
| **Medtronic, Inc.** | | | | |
| 1,312 % fällig am 15.03.2020 | | 6.100 | 6.089 | 0,40 |
| 1,375 % fällig am 01.04.2018 | | 2.700 | 2.686 | 0,17 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Low Average Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Merck & Co., Inc.** | | | |
| 0,716 % fällig am 10.02.2020 | $ 4.600 | $ 4.576 | 0,30 |
| **Merck Sharp & Dohme Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 30.06.2019 | 1.600 | 1.766 | 0,11 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 1,800 % fällig am 15.03.2018 | 200 | 199 | 0,01 |
| 1,950 % fällig am 12.09.2017 | 300 | 301 | 0,02 |
| **Pearson Dollar Finance Two PLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 06.05.2018 | 600 | 648 | 0,04 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2018 | 350 | 372 | 0,02 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 20.05.2022 | 4.500 | 4.459 | 0,29 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 12.06.2018 | 1.100 | 1.108 | 0,07 |
| **SABMiller Holdings, Inc.** | | | |
| 2,200 % fällig am 01.08.2018 | 1.300 | 1.297 | 0,08 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2022 | 300 | 309 | 0,02 |
| **SABMiller PLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.07.2018 | 300 | 331 | 0,02 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | |
| 3,192 % fällig am 27.04.2018 | 2.500 | 2.550 | 0,17 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | |
| 5,850 % fällig am 01.05.2017 | 700 | 733 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 01.07.2018 | 1.700 | 1.856 | 0,12 |
| 8,250 % fällig am 01.04.2019 | 1.100 | 1.264 | 0,08 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | |
| 1,400 % fällig am 15.12.2017 | 1.000 | 997 | 0,06 |
| 1,450 % fällig am 17.07.2017 | 1.500 | 1.500 | 0,10 |
| 1,900 % fällig am 16.07.2018 | 1.600 | 1.605 | 0,10 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 0,810 % fällig am 20.11.2017 | 7.600 | 7.306 | 0,47 |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | 4.500 | 4.317 | 0,28 |
| **Walgreens Boots Alliance, Inc.** | | | |
| 0,814 % fällig am 18.05.2016 | 4.500 | 4.485 | 0,29 |
| 1,750 % fällig am 17.11.2017 | 1.600 | 1.598 | 0,10 |
| **WestRock RKT Co.** | | | |
| 4,450 % fällig am 01.03.2019 | 400 | 417 | 0,03 |
| **Whirlpool Corp.** | | | |
| 1,650 % fällig am 01.11.2017 | 1.000 | 995 | 0,06 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2025 | 850 | 754 | 0,05 |
| | | 230.295 | 14,94 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | 14.000 | 13.915 | 0,90 |
| 2,950 % fällig am 15.05.2016 | 1.500 | 1.509 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | 2.500 | 2.444 | 0,16 |
| **Consumers Energy Co.** | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | 400 | 461 | 0,03 |
| **Dayton Power & Light Co.** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2016 | 2.200 | 2.202 | 0,14 |
| **Dominion Gas Holdings LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2019 | 2.300 | 2.299 | 0,15 |
| **DTE Energy Co.** | | | |
| 2,400 % fällig am 01.12.2019 | 1.700 | 1.694 | 0,11 |
| **Electricite de France S.A.** | | | |
| 6,500 % fällig am 26.01.2019 | 100 | 112 | 0,01 |
| **Exelon Corp.** | | | |
| 1,550 % fällig am 09.06.2017 | 700 | 697 | 0,05 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.02.2019 | 700 | 753 | 0,05 |
| **Kinder Morgan Finance Co. LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2018 | 1.300 | 1.311 | 0,09 |
| **Korea Gas Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 25.07.2017 | 1.300 | 1.308 | 0,08 |
| **KT Corp.** | | | |
| 1,750 % fällig am 22.04.2017 | 4.700 | 4.689 | 0,30 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | 13.900 | 13.587 | 0,88 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | 1.900 | 1.876 | 0,12 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | 500 | 381 | 0,02 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | 400 | 368 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | 100 | 93 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | 400 | 375 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | 1.600 | 1.596 | 0,10 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 8,750 % fällig am 01.05.2019 | $ 700 | $ 769 | 0,05 |
| **Southern Natural Gas Co. LLC** | | | |
| 5,900 % fällig am 01.04.2017 | 300 | 305 | 0,02 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | |
| 4,050 % fällig am 23.01.2020 | 2.500 | 1.816 | 0,12 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | 9.900 | 10.098 | 0,66 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 0,877 % fällig am 09.06.2017 | 2.800 | 2.789 | 0,18 |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 | 14.400 | 14.754 | 0,96 |
| 2,500 % fällig am 15.09.2016 | 10.543 | 10.627 | 0,69 |
| 2,550 % fällig am 17.06.2019 | 810 | 821 | 0,05 |
| | | 93.649 | 6,07 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | 683.222 | 44,32 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Alameda, California, University of California Revenue Bonds, Series 2011** | | | |
| 0,744 % fällig am 01.07.2041 | 9.300 | 9.298 | 0,61 |
| **Mercer, New Jersey, Economic Development Authority Revenue Bonds, Series 2014** | | | |
| 1,096 % fällig am 15.06.2016 | 4.800 | 4.800 | 0,31 |
| | | 14.098 | 0,92 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2040 (b) | 977 | 878 | 0,06 |
| 0,397 % fällig am 27.10.2037 | 2.062 | 2.052 | 0,13 |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | 136 | 128 | 0,01 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2044 | 104 | 104 | 0,01 |
| 0,832 % fällig am 25.09.2035 | 584 | 587 | 0,04 |
| 0,972 % fällig am 25.09.2041 | 22 | 22 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 25.01.2043 | 680 | 624 | 0,04 |
| 1,443 % fällig am 01.07.2042 - 01.06.2043 | 169 | 173 | 0,01 |
| 1,493 % fällig am 01.09.2041 | 190 | 194 | 0,01 |
| 1,931 % fällig am 01.01.2035 | 43 | 45 | 0,00 |
| 2,123 % fällig am 01.01.2035 | 29 | 31 | 0,00 |
| 2,235 % fällig am 01.01.2035 | 171 | 182 | 0,01 |
| 2,238 % fällig am 01.12.2034 | 110 | 115 | 0,01 |
| 2,333 % fällig am 01.07.2035 | 47 | 50 | 0,00 |
| 2,373 % fällig am 01.03.2035 | 12 | 12 | 0,00 |
| 2,393 % fällig am 01.12.2034 | 16 | 17 | 0,00 |
| 2,490 % fällig am 01.08.2035 | 542 | 576 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2018 - 01.03.2021 | 1.793 | 1.857 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 01.05.2023 - 01.10.2031 | 10.261 | 11.295 | 0,73 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.12.2029 | 317 | 353 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2019 - 01.05.2041 | 8.364 | 9.463 | 0,62 |
| 6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036 | 46 | 54 | 0,01 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 101.000 | 106.790 | 6,93 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 116.000 | 125.203 | 8,12 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2037 (b) | 1.225 | 1.104 | 0,07 |
| 0,651 % fällig am 15.02.2037 | 80 | 80 | 0,01 |
| 0,781 % fällig am 15.09.2041 | 45 | 45 | 0,00 |
| 1,740 % fällig am 01.02.2037 | 152 | 156 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026 | 18.900 | 19.012 | 1,23 |
| 2,275 % fällig am 01.12.2034 | 12 | 13 | 0,00 |
| 2,450 % fällig am 01.01.2035 | 27 | 29 | 0,00 |
| 2,505 % fällig am 01.07.2035 | 109 | 115 | 0,01 |
| 2,517 % fällig am 01.01.2035 | 16 | 17 | 0,00 |
| 2,521 % fällig am 01.09.2035 | 622 | 660 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2034 | 6 | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2022 - 01.12.2023 | 38 | 41 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,652 % fällig am 20.06.2065 | 3.564 | 3.538 | 0,23 |
| 0,892 % fällig am 20.10.2065 | 12.619 | 12.652 | 0,82 |
| 1,242 % fällig am 20.02.2062 | 75 | 76 | 0,01 |
| 1,892 % fällig am 20.02.2041 | 1.400 | 1.403 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 20.06.2027 | 74 | 75 | 0,01 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 3,080 % fällig am 25.09.2018 | $ 275 | $ 286 | 0,02 |
| | | 300.114 | 19,47 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2018 - 15.04.2019 (d)(e)(f)(g) | 271.404 | 270.506 | 17,55 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 (d) | 45.693 | 46.037 | 2,98 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 126 | 144 | 0,01 |
| | | 316.687 | 20,54 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,482 % fällig am 25.10.2036 | 61 | 33 | 0,00 |
| 1,397 % fällig am 25.11.2033 | 2.084 | 1.961 | 0,13 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,757 % fällig am 25.09.2035 | 398 | 333 | 0,02 |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2047 | 254 | 210 | 0,01 |
| 1,257 % fällig am 25.02.2036 | 476 | 420 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033 | 24 | 25 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,314 % fällig am 25.10.2034 | 196 | 196 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.02.2045 | 136 | 136 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | 3.100 | 2.786 | 0,18 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 1,002 % fällig am 25.07.2032 | 20 | 19 | 0,00 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,568 % fällig am 10.04.2049 | 5.601 | 5.768 | 0,37 |
| 5,617 % fällig am 10.07.2046 | 1.899 | 1.917 | 0,12 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.07.2037 | 1.980 | 1.699 | 0,11 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,677 % fällig am 25.07.2034 | 70 | 71 | 0,01 |
| 2,789 % fällig am 25.08.2034 | 3.313 | 3.282 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2031 | 9 | 9 | 0,00 |
| **BankUnited Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.09.2045 | 3.488 | 3.067 | 0,20 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,335 % fällig am 26.09.2035 | 805 | 799 | 0,05 |
| 2,280 % fällig am 26.07.2036 | 3.644 | 3.642 | 0,24 |
| 2,932 % fällig am 28.09.2036 | 995 | 992 | 0,06 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,813 % fällig am 25.11.2034 | 223 | 217 | 0,01 |
| 2,928 % fällig am 25.07.2034 | 562 | 545 | 0,04 |
| 3,059 % fällig am 25.01.2034 | 29 | 30 | 0,00 |
| 3,147 % fällig am 25.01.2035 | 44 | 43 | 0,00 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2034 | 180 | 165 | 0,01 |
| 2,480 % fällig am 25.12.2033 | 154 | 156 | 0,01 |
| 2,601 % fällig am 25.05.2035 | 259 | 252 | 0,02 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | 98 | 84 | 0,01 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | 532 | 495 | 0,03 |
| **Citigroup & Deutsche Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,289 % fällig am 11.12.2049 | 29.060 | 29.789 | 1,93 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,710 % fällig am 10.12.2049 | 3.500 | 3.620 | 0,24 |
| 6,137 % fällig am 10.12.2049 | 856 | 900 | 0,06 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 25.12.2018 | 11 | 11 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 1,112 % fällig am 25.09.2035 | 4.654 | 4.650 | 0,30 |
| 2,706 % fällig am 25.08.2035 (h) | 185 | 138 | 0,01 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2035 | 130 | 129 | 0,01 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,826 % fällig am 10.07.2038 | 578 | 582 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.09.2036 | 4.805 | 4.752 | 0,31 |
| 0,701 % fällig am 25.12.2031 (h) | 30 | 22 | 0,00 |
| 0,942 % fällig am 25.12.2035 | 8.998 | 8.907 | 0,58 |
| 1,397 % fällig am 25.06.2035 | 4.209 | 4.170 | 0,27 |
| 1,472 % fällig am 25.11.2034 | 4.092 | 3.910 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,602 % fällig am 20.02.2036 (h) | $ | 457 | $ 402 | 0,03 |
| 2,646 % fällig am 25.11.2034 | | 154 | 147 | 0,01 |
| 2,671 % fällig am 20.02.2035 | | 241 | 240 | 0,02 |
| 2,690 % fällig am 25.09.2033 | | 1.040 | 967 | 0,06 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,297 % fällig am 15.12.2039 | | 8.251 | 8.441 | 0,55 |
| 5,383 % fällig am 15.02.2040 | | 311 | 317 | 0,02 |
| 5,659 % fällig am 15.03.2039 | | 17.305 | 17.305 | 1,12 |
| 5,816 % fällig am 15.06.2038 | | 2.284 | 2.300 | 0,15 |
| 6,067 % fällig am 15.02.2041 | | 5.000 | 5.266 | 0,34 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | | 24 | 21 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,703 % fällig am 26.09.2047 | | 987 | 987 | 0,06 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 2,740 % fällig am 26.06.2035 | | 388 | 387 | 0,03 |
| **Eurosail-UK PLC** | | | | |
| 1,283 % fällig am 13.09.2045 | £ | 1.114 | 1.601 | 0,10 |
| 1,535 % fällig am 13.06.2045 | | 8.500 | 11.776 | 0,76 |
| **Extended Stay America Trust** | | | | |
| 2,958 % fällig am 05.12.2031 | $ | 500 | 502 | 0,03 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | | 249 | 254 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2043 | | 173 | 200 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | | 500 | 490 | 0,03 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.01.2037 | | 10 | 5 | 0,00 |
| 1,127 % fällig am 25.04.2035 | | 2.950 | 2.760 | 0,18 |
| **GE Commercial Mortgage Corporation Trust** | | | | |
| 5,483 % fällig am 10.12.2049 | | 8.003 | 8.294 | 0,54 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,462 % fällig am 25.08.2036 | | 5 | 3 | 0,00 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | £ | 1.571 | 2.322 | 0,15 |
| 2,135 % fällig am 19.12.2047 | | 128 | 189 | 0,01 |
| **Granite Mortgages PLC** | | | | |
| 0,329 % fällig am 20.01.2044 | € | 36 | 39 | 0,00 |
| 0,962 % fällig am 20.01.2044 | £ | 34 | 50 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 2.444 | 2.305 | 0,15 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.12.2036 | | 78 | 42 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,806 % fällig am 25.09.2035 | | 658 | 675 | 0,04 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | | 67 | 56 | 0,00 |
| 2,685 % fällig am 19.07.2035 | | 168 | 149 | 0,01 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | £ | 2.498 | 3.628 | 0,24 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,451 % fällig am 15.10.2054 | € | 1.868 | 2.030 | 0,13 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 | $ | 50 | 21 | 0,00 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.04.2035 | | 696 | 625 | 0,04 |
| **Infinity Classico** | | | | |
| 0,109 % fällig am 15.02.2024 | € | 786 | 840 | 0,06 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,257 % fällig am 15.05.2047 | $ | 6.806 | 6.912 | 0,45 |
| 5,397 % fällig am 15.05.2045 | | 1.068 | 1.080 | 0,07 |
| 5,794 % fällig am 12.02.2051 | | 3.446 | 3.586 | 0,23 |
| **JPMorgan Commercial Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 5,637 % fällig am 18.03.2051 | | 3.637 | 3.735 | 0,24 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | |
| 0,088 % fällig am 20.11.2022 | € | 1.196 | 1.274 | 0,08 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,342 % fällig am 15.09.2039 | $ | 3.139 | 3.194 | 0,21 |
| 5,641 % fällig am 15.03.2039 | | 3.983 | 3.985 | 0,26 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2033 | | 49 | 51 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.08.2036 | | 166 | 166 | 0,01 |
| 0,672 % fällig am 25.11.2035 | | 22 | 21 | 0,00 |
| **Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,172 % fällig am 12.12.2049 | $ | 82 | $ 83 | 0,01 |
| 5,485 % fällig am 12.03.2051 | | 400 | 410 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 1,085 % fällig am 15.03.2045 | | 17 | 17 | 0,00 |
| 5,569 % fällig am 15.12.2044 | | 8.162 | 8.503 | 0,55 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.08.2035 | | 2.100 | 2.042 | 0,13 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,620 % fällig am 25.10.2034 | | 2.038 | 2.021 | 0,13 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,794 % fällig am 15.08.2045 | | 20.585 | 21.145 | 1,37 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.02.2035 | | 613 | 600 | 0,04 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.12.2035 | | 1.170 | 1.038 | 0,07 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.02.2034 | | 12 | 11 | 0,00 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.03.2037 | | 1.204 | 1.168 | 0,08 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 1,617 % fällig am 25.09.2045 | | 790 | 651 | 0,04 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.09.2035 (h) | | 288 | 231 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 (h) | | 142 | 56 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 20.06.2036 | | 994 | 885 | 0,06 |
| 1,007 % fällig am 20.10.2027 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.12.2036 | | 1.165 | 1.161 | 0,08 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,540 % fällig am 25.01.2035 | | 1.792 | 1.713 | 0,11 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 1,397 % fällig am 25.10.2033 | | 1.614 | 1.568 | 0,10 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.03.2037 | | 507 | 391 | 0,03 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | | 78 | 68 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.03.2036 | | 3.168 | 3.060 | 0,20 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2035 | | 1.000 | 907 | 0,06 |
| **Taurus Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 22.04.2028 | € | 3.800 | 4.130 | 0,27 |
| **Taurus IT Srl** | | | | |
| 1,414 % fällig am 18.02.2027 | | 2.847 | 3.062 | 0,20 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 25.04.2043 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| **Vulcan European Loan Conduit No.28 Ltd.** | | | | |
| 0,199 % fällig am 15.05.2017 | € | 288 | 310 | 0,02 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,749 % fällig am 15.07.2045 | $ | 2.453 | 2.475 | 0,16 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 25.01.2045 | | 1.962 | 1.860 | 0,12 |
| 1,643 % fällig am 25.08.2042 | | 47 | 44 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.06.2042 | | 29 | 28 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.05.2036 | | 1.400 | 1.322 | 0,09 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,736 % fällig am 25.03.2035 | | 5.044 | 5.110 | 0,33 |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 (h) | | 1.939 | 1.875 | 0,12 |
| 2,823 % fällig am 25.01.2035 | | 110 | 112 | 0,01 |
| 2,853 % fällig am 25.12.2034 | | 92 | 91 | 0,01 |
| | | | 258.738 | 16,78 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ares European CLO III BV** | | | | |
| 0,256 % fällig am 15.08.2024 | € | 1.755 | 1.899 | 0,12 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl** | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | | 6.975 | 7.585 | 0,49 |
| **Atrium VII** | | | | |
| 1,464 % fällig am 16.11.2022 | $ | 3.204 | 3.192 | 0,21 |
| **Avoca CLO VI PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 16.01.2023 | € | 415 | 452 | 0,03 |
| **Cadogan Square CLO II BV** | | | | |
| 0,278 % fällig am 12.08.2022 | € | 432 | $ 469 | 0,03 |
| **Cadogan Square CLO III BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 17.01.2023 | | 2.169 | 2.337 | 0,15 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 1,547 % fällig am 20.04.2022 | $ | 4.700 | 4.678 | 0,30 |
| **Carlyle High Yield Partners X Ltd.** | | | | |
| 0,540 % fällig am 19.04.2022 | | 888 | 864 | 0,06 |
| **Cavalry CLO V Ltd.** | | | | |
| 1,687 % fällig am 16.01.2024 | | 9.500 | 9.471 | 0,61 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,615 % fällig am 19.01.2023 | | 4.654 | 4.652 | 0,30 |
| 1,802 % fällig am 05.12.2024 | | 4.900 | 4.882 | 0,32 |
| **Cornerstone CLO Ltd.** | | | | |
| 0,541 % fällig am 15.07.2021 | | 3.412 | 3.387 | 0,22 |
| **Doral CLO II Ltd.** | | | | |
| 1,657 % fällig am 26.05.2023 | | 6.700 | 6.692 | 0,43 |
| **Duane Street CLO IV Ltd.** | | | | |
| 0,592 % fällig am 14.11.2021 | | 384 | 379 | 0,03 |
| **Elm CLO Ltd.** | | | | |
| 1,715 % fällig am 17.01.2023 | | 7.841 | 7.865 | 0,51 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 2.142 | 2.316 | 0,15 |
| **Fortress Credit Investments IV Ltd.** | | | | |
| 1,565 % fällig am 17.07.2023 | $ | 4.668 | 4.667 | 0,30 |
| **Four Corners CLO II Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 26.01.2020 | | 817 | 812 | 0,05 |
| **Fraser Sullivan CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,362 % fällig am 20.04.2023 | | 4.244 | 4.240 | 0,28 |
| **Galaxy XI CLO Ltd.** | | | | |
| 1,660 % fällig am 20.08.2022 | | 1.205 | 1.204 | 0,08 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | € | 1.010 | 1.097 | 0,07 |
| **Goldentree Loan Opportunities V Ltd.** | | | | |
| 1,010 % fällig am 18.10.2021 | $ | 1.151 | 1.146 | 0,07 |
| **Highbridge Loan Management Ltd.** | | | | |
| 1,820 % fällig am 20.09.2022 | | 6.063 | 6.053 | 0,39 |
| **Inwood Park CDO Ltd.** | | | | |
| 0,542 % fällig am 20.01.2021 | | 2.676 | 2.674 | 0,17 |
| **Jubilee CDO V BV** | | | | |
| 0,282 % fällig am 21.08.2021 | € | 403 | 436 | 0,03 |
| **LCM XII LP** | | | | |
| 1,575 % fällig am 19.10.2022 | $ | 4.900 | 4.869 | 0,32 |
| **Lockwood Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 1,690 % fällig am 25.01.2024 | | 5.100 | 5.082 | 0,33 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,762 % fällig am 15.06.2022 | | 773 | 773 | 0,05 |
| **Mercator CLO II PLC** | | | | |
| 0,149 % fällig am 18.02.2024 | € | 752 | 811 | 0,05 |
| **MOTOR PLC** | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.06.2022 | $ | 9.000 | 8.976 | 0,58 |
| **MT Wilson CLO II Ltd.** | | | | |
| 0,551 % fällig am 11.07.2020 | | 1.152 | 1.151 | 0,08 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,531 % fällig am 15.12.2028 | | 2.100 | 2.082 | 0,14 |
| **Panther CDO IV BV** | | | | |
| 0,304 % fällig am 20.03.2084 | € | 2.543 | 2.668 | 0,17 |
| **Prospero CLO II BV** | | | | |
| 0,189 % fällig am 20.10.2022 | | 82 | 88 | 0,01 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 15.09.2026 | $ | 5.000 | 4.808 | 0,31 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 15.03.2024 | | 1.501 | 1.482 | 0,10 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,081 % fällig am 16.10.2023 | | 321 | 321 | 0,02 |
| 1,381 % fällig am 15.06.2023 | | 1.083 | 1.083 | 0,07 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,410 % fällig am 25.10.2024 | | 4.446 | 4.355 | 0,28 |
| 0,512 % fällig am 15.12.2027 | € | 6.300 | 6.546 | 0,43 |
| 0,820 % fällig am 25.10.2017 | $ | 889 | 888 | 0,06 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | |
| 1,164 % fällig am 02.03.2020 | | 1.391 | 1.378 | 0,09 |
| 1,414 % fällig am 03.09.2024 | | 1.000 | 987 | 0,06 |
| **Stone Tower CLO VI Ltd.** | | | | |
| 0,545 % fällig am 17.04.2021 | | 849 | 839 | 0,05 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Low Average Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,616 % fällig am 27.11.2031 | € | 8.310 | $ 9.034 | 0,59 |
| **Symphony CLO IX LP** | | | | |
| 1,617 % fällig am 16.04.2022 | $ | 890 | 886 | 0,06 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 4.200 | 4.168 | 0,27 |
| 1,641 % fällig am 15.10.2022 | | 4.100 | 4.078 | 0,26 |
| **Wood Street CLO 1 BV** | | | | |
| 0,231 % fällig am 22.11.2021 | € | 390 | 422 | 0,03 |
| | | | 151.224 | 9,81 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 3.000 | 3.448 | 0,22 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 170.800 | 40.275 | 2,61 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,260 %) fällig am 11.03.2016 | CZK | 59.000 | 2.373 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,071 % fällig am 14.01.2017 | $ | 7.000 | $ 7.012 | 0,46 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 3,250 % fällig am 09.03.2016 | | 4.700 | 4.719 | 0,31 |
| 3,250 % fällig am 20.09.2016 | | 2.580 | 2.614 | 0,17 |
| **Korea Housing Finance Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.12.2016 | | 500 | 508 | 0,03 |
| **Korea Land & Housing Corp.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.08.2017 | | 1.300 | 1.298 | 0,09 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 16.06.2016 (c) | MXN | 46.286 | 2.741 | 0,18 |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | | 440.900 | 28.100 | 1,82 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 1,100 % fällig am 25.10.2017 | $ | 17.000 | 16.928 | 1,10 |
| 1,600 % fällig am 21.09.2016 | | 13.200 | 13.253 | 0,86 |
| | | | 123.269 | 8,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Citigroup Capital XIII** | | | |
| 6,692 % fällig am 30.10.2040 | 475.000 | $ 12.345 | 0,80 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | 498.260 | 50.126 | 3,25 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 570.714 | 5.708 | 0,37 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.943.326** | **126,06** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 60 | $ (28) | 0,00 |
| 90-Day Sterling June Futures | Short | 06/2017 | 1.782 | (874) | (0,06) |
| 90-Day Sterling March Futures | Short | 03/2017 | 56 | (31) | 0,00 |
| US Treasury 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 488 | (176) | (0,01) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.510 | (531) | (0,03) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 491 | 183 | 0,01 |
| | | | | $ (1.457) | (0,09) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (1.457)** | **(0,09)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-21 Index | 1,000 % | 20.12.2016 | $ 31.400 | $ (316) | (0,02) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2019 | $ 224.100 | $ (2.729) | (0,18) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 11.700 | 199 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 45.400 | 152 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,880 % | 05.10.2017 | £ 6.000 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,837 % | 06.10.2017 | 1.300 | (32) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | 30.400 | (86) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,980 % | 26.08.2024 | MXN 138.500 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,865 % | 12.03.2025 | 200.700 | (389) | (0,02) |
| | | | | | $ (2.885) | (0,19) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (3.201)** | **(0,21)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,082 | 15.01.2016 | € 10.400 | $ (66) | $ (57) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | BRL 4,450 | 14.01.2016 | $ 10.500 | (216) | (5) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,600 | 14.03.2016 | 8.800 | (248) | (83) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 6,850 | 01.06.2016 | 3.700 | (34) | (42) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus japanese yen | BOA | JPY 80,000 | 18.02.2019 | 13.600 | (773) | (85) | (0,01) |
| | | | | | $ (1.337) | $ (272) | (0,02) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | $ 21.800 | $ (88) | $ (55) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | 26.000 | (101) | (66) | (0,01) |
| | | | | | | | $ (189) | $ (121) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | $ 6.000 | $ 105 | $ 96 | $ 9 | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 2.700 | 47 | 57 | (10) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2019 | BOA | € 4.300 | 38 | 94 | (56) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2019 | BPS | 5.400 | 47 | 121 | (74) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 700 | 6 | 16 | (10) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2019 | MYC | 3.300 | 29 | 76 | (47) | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.03.2020 | MYC | 1.000 | 7 | 17 | (10) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2017 | CBK | $ 2.600 | (51) | (29) | (22) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2017 | DUB | 3.200 | (63) | (34) | (29) | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 1.400 | 12 | 7 | 5 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 4.600 | 40 | 2 | 38 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 2.700 | 27 | 27 | 0 | 0,00 |
| Continental AG | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | € 2.100 | 43 | 6 | 37 | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | $ 4.000 | 24 | (324) | 348 | 0,00 |
| HSBC Bank PLC | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | € 5.500 | 47 | (55) | 102 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | $ 4.500 | 66 | 33 | 33 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 2.700 | 40 | 46 | (6) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2018 | BRC | 1.600 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | CBK | 4.000 | 13 | 20 | (7) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 3.400 | (18) | (3) | (15) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | DUB | 1.400 | 5 | 7 | (2) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 4.000 | 13 | 19 | (6) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 1.400 | 5 | 8 | (3) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | MYC | 3.000 | (16) | (6) | (10) | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | FBF | 4.400 | 60 | 89 | (29) | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | JPM | 6.700 | 91 | 136 | (45) | 0,01 |
| PSEG Power LLC | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 3.500 | 42 | 22 | 20 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | BRC | € 700 | (4) | (14) | 10 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 600 | (7) | (36) | 29 | 0,00 |
| Wendel S.A. | 5,000 % | 20.12.2019 | BOA | 1.400 | 253 | 346 | (93) | 0,02 |
| Wendel S.A. | 5,000 % | 20.12.2019 | FBF | 400 | 72 | 98 | (26) | 0,01 |
| Wendel S.A. | 5,000 % | 20.12.2019 | GST | 1.000 | 181 | 251 | (70) | 0,01 |
| | | | | | $ 1.153 | $ 1.090 | $ 63 | 0,07 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CMBX.AAA-3 Index | 0,080 % | 13.12.2049 | MYC | $ 8.604 | $ (34) | $ (59) | $ 25 | 0,00 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Low Average Duration Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | BRL 42.700 | $ 1.041 | $ (90) | $ 1.131 | 0,07 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 14.318 | $ | 3.667 | BOA | $ 48 | $ 0 | $ 48 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.682 | BRL | 14.318 | BOA | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 130.000 | $ | 40.304 | BPS | 7.444 | 0 | 7.444 | 0,48 |
| 01/2016 | $ | 33.400 | BRL | 130.000 | BPS | 0 | (541) | (541) | (0,04) |
| 01/2016 | | 342 | | 1.368 | BRC | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.368 | $ | 350 | BRC | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.258 | BRL | 5.000 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 5.000 | $ | 1.264 | CBK | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 20.385 | BRL | 79.237 | DUB | 0 | (357) | (357) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 79.237 | $ | 20.824 | DUB | 796 | 0 | 796 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 12.182 | BRL | 48.221 | GLM | 32 | (26) | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 48.221 | $ | 12.415 | GLM | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| 01/2016 | | 26.065 | | 6.675 | JPM | 87 | 0 | 87 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 6.890 | BRL | 26.065 | JPM | 0 | (302) | (302) | (0,02) |
| 01/2016 | | 16.437 | | 65.500 | MSB | 119 | 0 | 119 | 0,01 |
| 01/2016 | BRL | 65.500 | $ | 16.774 | MSB | 218 | 0 | 218 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 575 | BRL | 2.323 | SCX | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.323 | $ | 595 | SCX | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 29 | € | 27 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 6 | $ | 6 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 497 | | 542 | RBC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 87 | £ | 59 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 533 | $ | 801 | BOA | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 68 | £ | 46 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 47 | | 31 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 38.520 | $ | 58.069 | DUB | 1.294 | 0 | 1.294 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 1.624 | £ | 1.077 | JPM | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8 | | 5 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 56.203 | | 37.976 | SCX | 0 | (231) | (231) | (0,02) |
| 01/2016 | | 1.030 | INR | 68.604 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 50.610 | $ | 762 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.130 | JPY | 139.300 | CBK | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 9.477.767 | $ | 77.370 | GLM | 0 | (1.417) | (1.417) | (0,09) |
| 01/2016 | $ | 19.150 | JPY | 2.343.800 | GLM | 334 | 0 | 334 | 0,02 |
| 01/2016 | | 58.293 | | 7.058.067 | MSB | 380 | 0 | 380 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY | 355.600 | $ | 2.932 | MSB | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.723 | JPY | 943.900 | UAG | 123 | 0 | 123 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 651.700 | $ | 5.310 | UAG | 0 | (108) | (108) | (0,01) |
| 01/2016 | KRW | 1.978.230 | | 1.725 | CBK | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.916.192 | | 1.639 | DUB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.639 | KRW | 1.916.192 | DUB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 3.815.860 | $ | 3.337 | FBF | 92 | 0 | 92 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 796 | KRW | 922.166 | GLM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 811 | | 940.355 | HUS | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 1.916.192 | $ | 1.678 | JPM | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.927.454 | | 1.662 | JPM | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.564 | KRW | 7.682.276 | UAG | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 25.692 | $ | 5.950 | DUB | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 14.441 | | 3.389 | SCX | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.635 | | 620 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 90.306 | | 1.918 | GLM | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.888 | PHP | 89.039 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.251 | RUB | 279.318 | BRC | 0 | (444) | (444) | (0,03) |
| 01/2016 | RUB | 279.318 | $ | 3.881 | JPM | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| 01/2016 | THB | 69.257 | | 1.919 | NGF | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 919 | BRL | 3.691 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.591 | | 18.096 | DUB | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 367 | $ | 366 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 21.117 | | 22.858 | BOA | 0 | (103) | (103) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 37.229 | € | 34.791 | CBK | 600 | 0 | 600 | 0,04 |
| 02/2016 | € | 13.050 | $ | 17.561 | DUB | 3.376 | 0 | 3.376 | 0,22 |
| 02/2016 | | 17.631 | | 19.118 | JPM | 15 | (68) | (53) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 14.174 | £ | 9.520 | JPM | 0 | (141) | (141) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 37.976 | $ | 56.207 | SCX | 231 | 0 | 231 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.599 | ILS | 6.194 | BOA | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.687 | | 14.301 | BPS | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | | 540 | | 2.096 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.852 | | 7.203 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 385 | | 1.494 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.106 | | 8.052 | JPM | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.451 | | 32.685 | SOG | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 71.805 | $ | 18.433 | UAG | 0 | (36) | (36) | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ | 9.416 | JPY | 1.157.000 | CBK | $ 210 | $ 0 | $ 210 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 620.500 | $ | 5.039 | JPM | 0 | (123) | (123) | (0,01) |
| 02/2016 | | 7.058.067 | | 58.326 | MSB | 0 | (384) | (384) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 21.636 | JPY | 2.646.400 | UAG | 381 | 0 | 381 | 0,02 |
| 02/2016 | SGD | 5.159 | $ | 3.620 | BOA | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.267 | | 898 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 124 | | 88 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.486 | | 2.462 | SOG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 75.668 | | 2.090 | HUS | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | | 159.662 | | 4.424 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 03/2016 | CZK | 59.000 | | 2.354 | MSB | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 1.010 | MXN | 17.445 | BRC | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 03/2016 | | 106 | | 1.813 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 561.960 | $ | 32.231 | SOG | 0 | (144) | (144) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 4.721 | RUB | 336.196 | BOA | 0 | (219) | (219) | (0,01) |
| 03/2016 | | 3.403 | | 250.940 | BPS | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.265 | | 93.129 | GLM | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.033 | | 76.204 | JPM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 03/2016 | | 1.347 | | 96.822 | MSB | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| 04/2016 | | 3.790 | | 279.318 | JPM | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| 06/2016 | | 2.484 | € | 1.839 | BOA | 0 | (477) | (477) | (0,03) |
| 06/2016 | € | 8.261 | $ | 11.374 | BOA | 2.354 | 0 | 2.354 | 0,15 |
| 06/2016 | | 37.306 | | 51.020 | BOA | 10.306 | 0 | 10.306 | 0,67 |
| 06/2016 | | 9.141 | | 12.569 | BRC | 2.589 | 0 | 2.589 | 0,17 |
| 06/2016 | | 13.640 | | 18.676 | DUB | 3.790 | 0 | 3.790 | 0,25 |
| 06/2016 | $ | 5.636 | € | 4.170 | DUB | 0 | (1.085) | (1.085) | (0,07) |
| 06/2016 | € | 12.230 | $ | 16.821 | MSB | 3.473 | 0 | 3.473 | 0,23 |
| 07/2016 | BRL | 170.800 | | 48.856 | DUB | 8.220 | 0 | 8.220 | 0,53 |
| 10/2016 | | 29.664 | | 7.786 | DUB | 947 | 0 | 947 | 0,06 |
| 10/2016 | CNH | 4.923 | | 753 | JPM | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 10/2016 | | 50.405 | | 7.709 | SCX | 251 | 0 | 251 | 0,02 |
| 12/2016 | | 26.578 | | 4.000 | HUS | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| 12/2016 | | 51.541 | | 7.747 | MSB | 149 | 0 | 149 | 0,01 |
| | | | | | | $ 48.557 | $ (6.825) | $ 41.732 | 2,71 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 43.499** | **2,82** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.01.2046 (j) | $ (2.000) | $ (2.230) | (0,14) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (2.230)** | **(0,14)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ 19.700 | $ 19.716 | 1,28 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 19.716** | **1,28** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.999.653** | **129,72** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | |
| **ANZ National Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ 407 | $ 600 | 0,04 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 195 | 195 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD 249 | 181 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY 54 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 5.411 | 5.411 | 0,35 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF 23 | 23 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY 1 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ 2 | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 59 | 59 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD 2 | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 1.688 | 1.688 | 0,11 |
| **Credit Suisse AG** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF 469 | 468 | 0,03 |
| **HSBC Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 1.626 | 1.626 | 0,11 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Low Average Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 146 | $ 106 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 23 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 128 | 189 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 38 | 38 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 10.591** | **0,69** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (468.691)** | **(30,41)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 1.541.553** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(b) **Reines Kapitalwertpapier.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 194.973 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(e) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.011 und Barmittel in Höhe von USD 300 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.720 und Barmittel in Höhe von USD 931 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(g) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.832 und Barmittel in Höhe von USD 1.631 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(h) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(i) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 600 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(i) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(k) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 89.535 | $ 1.852.793 | $ 998 | $ 1.943.326 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 19.716 | 0 | 19.716 |
| Finanzderivate[3] | (1.457) | 40.298 | 0 | 38.841 |
| Leerverkäufe | 0 | (2.230) | 0 | (2.230) |
| **Summen** | **$ 88.078** | **$ 1.910.577** | **$ 998** | **$ 1.999.653** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 224.472 | $ 1.837.390 | $ 1.586 | $ 2.063.448 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 19.741 | 0 | 19.741 |
| Finanzderivate[3] | (2.718) | 26.751 | 0 | 24.033 |
| Leerverkäufe | 0 | (2.238) | 0 | (2.238) |
| **Summen** | **$ 221.754** | **$ 1.881.644** | **$ 1.586** | **$ 2.104.984** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(l) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional AUD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD 2.605 | $ 1.868 | AZD | $ 0 | $ (27) | $ (27) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.812 | AUD 2.512 | BOA | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | 4 | 5 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 1.803 | AUD 2.500 | CBK | $ 16 | $ 0 | $ 16 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 2.605 | $ 1.893 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.802 | AUD 2.500 | DUB | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.803 | 2.500 | GLM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD 846 | $ 617 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | 2.605 | 1.894 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | 1.350 | 976 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | $ 1.866 | AUD 2.605 | AZD | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| 02/2016 | 1.891 | 2.605 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | 617 | 846 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.891 | 2.605 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | 975 | 1.350 | UAG | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | $ 101 | $ (38) | $ 63 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 73.296 | € 68.746 | BOA | $ 1.383 | $ 0 | $ 1.383 | 0,09 |
| 01/2016 | € 71.222 | $ 78.251 | BOA | 888 | (5) | 883 | 0,06 |
| 01/2016 | 1.090 | 1.195 | BPS | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | 288 | 313 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 3.160 | 3.403 | CBK | 7 | (36) | (29) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 412 | € 380 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 392 | $ 419 | DUB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 51.505 | € 48.609 | GLM | 1.299 | 0 | 1.299 | 0,08 |
| 01/2016 | 73.455 | 68.928 | HUS | 1.422 | 0 | 1.422 | 0,09 |
| 01/2016 | € 71.004 | $ 78.030 | HUS | 898 | 0 | 898 | 0,06 |
| 01/2016 | $ 17.485 | € 15.952 | JPM | 0 | (156) | (156) | (0,01) |
| 01/2016 | € 59.041 | $ 64.518 | JPM | 382 | 0 | 382 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 96 | € 91 | NAB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | 605 | 554 | RBC | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | 556 | 508 | SCX | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | 2 | 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 75.355 | 70.899 | UAG | 1.663 | 0 | 1.663 | 0,11 |
| 01/2016 | € 68.736 | $ 75.057 | UAG | 408 | (19) | 389 | 0,03 |
| 02/2016 | $ 78.075 | € 71.004 | BOA | 0 | (888) | (888) | (0,06) |
| 02/2016 | € 4.191 | $ 4.605 | BOA | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 78.085 | € 71.004 | HUS | 0 | (898) | (898) | (0,06) |
| 02/2016 | 64.563 | 59.041 | JPM | 0 | (381) | (381) | (0,02) |
| 02/2016 | € 1 | $ 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 74.281 | € 67.957 | UAG | 0 | (408) | (408) | (0,03) |
| | | | | $ 8.412 | $ (2.806) | $ 5.606 | 0,36 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 525 | $ 790 | AZD | $ 15 | $ 0 | $ 15 | 0,00 |
| 01/2016 | 8.240 | 12.469 | BOA | 324 | 0 | 324 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 27.662 | £ 18.381 | BPS | 0 | (570) | (570) | (0,04) |
| 01/2016 | £ 620 | $ 937 | BPS | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 01/2016 | 89 | 131 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 27.770 | £ 18.381 | CBK | 0 | (678) | (678) | (0,04) |
| 01/2016 | £ 22.262 | $ 33.065 | CBK | 253 | 0 | 253 | 0,01 |
| 01/2016 | 58 | 87 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 27.745 | £ 18.405 | DUB | 0 | (619) | (619) | (0,04) |
| 01/2016 | 6.615 | 4.397 | HUS | 0 | (134) | (134) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 16.346 | $ 24.263 | JPM | 170 | 0 | 170 | 0,01 |
| 01/2016 | 16.187 | 23.965 | MSB | 107 | 0 | 107 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 27.792 | £ 18.434 | MSB | 0 | (622) | (622) | (0,04) |
| 01/2016 | £ 5 | $ 8 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 13.747 | 20.346 | SCX | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| 01/2016 | 336 | 503 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 24.086 | £ 16.230 | CBK | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| 02/2016 | 24.022 | 16.187 | JPM | 0 | (162) | (162) | (0,01) |
| 02/2016 | 23.966 | 16.187 | MSB | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| 02/2016 | 20.347 | 13.747 | SCX | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| 02/2016 | £ 230 | $ 343 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 991 | $ (3.139) | $ (2.148) | (0,14) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ 5 | ILS 19 | BPS | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS 19 | $ 5 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 5 | ILS 19 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 9 | 35 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 5 | 19 | SOG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

**(m) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) and Class R EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 8.305 | $ 9.064 | $ (35) | $ 0 | $ (35) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(n) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,700 % | 27.11.2015 | 08.01.2016 | $ 8.240 | $ (8.246) | (0,53) |
| BSN | 0,360 % | 14.10.2015 | 14.01.2016 | 13.974 | (13.985) | (0,91) |
| BSN | 0,450 % | 12.11.2015 | 12.01.2016 | 52.094 | (52.126) | (3,38) |
| GRE | 0,950 % | 02.12.2015 | 04.01.2016 | 4.434 | (4.438) | (0,29) |
| GRE | 1,100 % | 22.12.2015 | 05.01.2016 | 1.435 | (1.435) | (0,09) |
| IND | 0,330 % | 07.10.2015 | 07.01.2016 | 2.454 | (2.456) | (0,16) |
| IND | 0,480 % | 18.11.2015 | 19.01.2016 | 27.304 | (27.320) | (1,77) |
| RDR | 0,440 % | 08.10.2015 | 08.04.2016 | 84.949 | (85.037) | (5,52) |
| | | | | | $ (195.043) | (12,65) |

**(o) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungs-geschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | 0,373 % | 09.10.2015 | 07.01.2016 | $ 17.190 | $ (17.205) | (1,12) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(p) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 15 | $ 0 | $ 15 |
| BOA | 13.763 | (13.560) | 203 |
| BPS | 6.406 | (6.440) | (34) |
| BRC | 2.314 | (2.240) | 74 |
| CBK | 299 | (540) | (241) |
| DUB | 17.382 | (19.420) | (2.038) |
| FBF | 141 | 0 | 141 |
| GLM | 388 | (990) | (602) |
| GST | 194 | (210) | (16) |
| HUS | 1.355 | (1.960) | (605) |
| JPM | (516) | 510 | (6) |
| MSB | 3.238 | (3.230) | 8 |
| MYC | (80) | 20 | (60) |
| NAB | 2 | 0 | 2 |
| NGF | (5) | 0 | (5) |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 265 | (120) | 145 |
| SOG | (179) | 70 | (109) |
| UAG | 2.004 | (2.690) | (686) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(q) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 126,06 | 100,26 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,09) | (0,13) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,21) | (0,04) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 2,82 | 1,34 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (0,14) | (0,11) |
| Summe Einlagenzertifikate | 1,28 | 0,96 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Low Average Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 94.875.452 | $ | 949.324 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | $ | 101.444 | | 102.528 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 60.000 | | 85.372 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 170.800 | | 47.894 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2016 | | 130.000 | | 39.713 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | MXN | 440.900 | | 29.707 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.05.2016 | € | 18.600 | | 22.475 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.09.2015 | $ | 19.000 | | 19.380 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 16.500 | | 16.500 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,061 % fällig am 04.06.2017 | | 14.750 | | 14.749 |
| **Eurosail-UK PLC** | | | | |
| 1,535 % fällig am 13.06.2045 | £ | 8.500 | | 12.823 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,892 % fällig am 20.10.2065 | $ | 12.800 | | 12.792 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | | 9.900 | | 10.828 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.01.2019 | | 10.400 | | 10.421 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | | 10.036 | | 10.024 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 1,615 % fällig am 19.01.2023 | | 9.500 | | 9.500 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,457 % fällig am 10.06.2020 | | 9.400 | | 9.400 |
| **Alameda, California, University of California Revenue Bonds, Series 2011** | | | | |
| 0,744 % fällig am 01.07.2041 | | 9.300 | | 9.300 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,022 % fällig am 15.06.2018 | | 9.300 | | 9.300 |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 | | 9.200 | | 9.200 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 107.722.987 | $ | 1.077.900 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.05.2016 | € | 73.800 | | 89.140 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | | 60.000 | | 85.465 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,150 % fällig am 15.05.2017 | | 52.900 | | 63.169 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 130.000 | | 33.028 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,280 % fällig am 25.07.2016 | $ | 30.100 | | 30.194 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,027 % fällig am 26.02.2016 | | 28.200 | | 28.256 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2018 (b) | | 26.043 | | 26.208 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 18.07.2015 | | 20.800 | | 20.883 |
| **H.J. Heinz Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.06.2020 | | 19.004 | | 19.004 |
| **NBCUniversal Enterprise, Inc.** | | | | |
| 0,858 % fällig am 15.04.2016 | | 13.900 | | 13.917 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,300 % fällig am 30.07.2016 | € | 11.000 | | 13.544 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2015 | $ | 12.600 | | 12.663 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.08.2016 | | 11.800 | | 12.335 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.10.2016 | € | 8.600 | | 10.833 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 0,748 % fällig am 31.05.2017 | | 9.450 | | 10.806 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 31.01.2017 | | 8.500 | | 10.700 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,676 % fällig am 15.06.2016 | $ | 10.400 | | 10.621 |
| **Becton Dickinson & Co.** | | | | |
| 0,962 % fällig am 15.06.2016 | | 10.300 | | 10.303 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.09.2016 | | 7.989 | | 8.089 |

(a) Der Low Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund



| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.10.2020 | $ | 44 | $ 44 | 0,05 |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.05.2021 | | 43 | 43 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | | 200 | 198 | 0,24 |
| **CPG International, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.09.2020 | | 100 | 94 | 0,11 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 299 | 297 | 0,36 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | | 42 | 42 | 0,05 |
| **Delos Finance Sarl** | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.03.2021 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | | 322 | 322 | 0,39 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 200 | 200 | 0,24 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 222 | 222 | 0,27 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 299 | 296 | 0,36 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.07.2018 | | 14 | 13 | 0,02 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.06.2021 | | 100 | 85 | 0,10 |
| | | | 1.956 | 2,36 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Abbey National Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2020 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | | 200 | 199 | 0,24 |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 150 | 154 | 0,18 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **alstria office REIT-AG** | | | | |
| 2,250 % fällig am 24.03.2021 | € | 100 | 108 | 0,13 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 31.07.2018 | $ | 1.000 | 999 | 1,20 |
| 1,875 % fällig am 05.11.2018 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.06.2022 | | 500 | 541 | 0,65 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 100 | 99 | 0,12 |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.11.2018 | | 250 | 250 | 0,30 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | € | 100 | 111 | 0,13 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 25.08.2017 | $ | 100 | 100 | 0,12 |
| 2,650 % fällig am 01.04.2019 | | 800 | 803 | 0,97 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 225 | 241 | 0,29 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 11.09.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 2,600 % fällig am 17.08.2020 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 16.08.2019 | £ | 50 | 83 | 0,10 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | $ | 200 | 214 | 0,26 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 16.03.2018 | | 1.000 | 995 | 1,20 |
| **BBVA Banco Continental S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.07.2016 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 1.325 | 1.462 | 1,76 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 20.08.2018 | | 1.000 | 1.015 | 1,22 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 10.12.2018 | | 500 | 505 | 0,61 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | $ | 500 | $ 550 | 0,66 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,050 % fällig am 07.12.2018 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 1.100 | 1.092 | 1,32 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 2,250 % fällig am 14.01.2020 | | 1.000 | 996 | 1,20 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 100 | 130 | 0,16 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 100 | 103 | 0,12 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 200 | 221 | 0,27 |
| **Credit Suisse** | | | | |
| 0,897 % fällig am 26.05.2017 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | | 25 | 25 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 10.12.2020 | | 350 | 349 | 0,42 |
| **Digital Delta Holdings LLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.10.2020 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.07.2019 | | 25 | 25 | 0,03 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2067 | | 600 | 628 | 0,76 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,061 % fällig am 04.06.2017 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 1,312 % fällig am 15.12.2017 | | 25 | 25 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 1.000 | 1.100 | 1,32 |
| 5,950 % fällig am 18.01.2018 | | 100 | 108 | 0,13 |
| **Goodman Funding Pty Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.04.2021 | | 500 | 569 | 0,68 |
| **HCP, Inc.** | | | | |
| 6,700 % fällig am 30.01.2018 | | 50 | 54 | 0,07 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 05.03.2018 | | 1.000 | 995 | 1,20 |
| 2,250 % fällig am 23.06.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 2,350 % fällig am 05.03.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 26.11.2018 | | 200 | 199 | 0,24 |
| 2,700 % fällig am 17.08.2020 | | 200 | 201 | 0,24 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2020 | | 500 | 500 | 0,60 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.01.2018 | | 200 | 205 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 23.01.2020 | | 100 | 98 | 0,12 |
| 2,550 % fällig am 29.10.2020 | | 500 | 496 | 0,60 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 13.02.2025 | | 50 | 46 | 0,06 |
| 6,850 % fällig am 15.06.2017 | | 5 | 5 | 0,01 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.09.2018 | € | 100 | 110 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 22.01.2019 | $ | 400 | 395 | 0,48 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.08.2018 | | 200 | 200 | 0,24 |
| 2,400 % fällig am 17.03.2020 | | 200 | 199 | 0,24 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 1,950 % fällig am 03.12.2018 | | 150 | 150 | 0,18 |
| **mFinance France S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.04.2019 | € | 50 | 55 | 0,07 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.10.2020 | $ | 200 | 200 | 0,24 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,650 % fällig am 27.01.2020 | | 1.000 | 998 | 1,20 |
| 5,500 % fällig am 24.07.2020 | | 100 | 111 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 28.08.2017 | | 100 | 107 | 0,13 |
| **MUFG Americas Holdings Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 10.02.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.02.2020 | | 500 | 572 | 0,69 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 25 | 22 | 0,03 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 2,500 % fällig am 17.09.2020 | | 500 | 498 | 0,60 |
| **PNC Bank N.A.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 01.06.2020 | | 250 | 248 | 0,30 |
| **Principal Life Global Funding II** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.11.2020 | $ | 100 | $ 100 | 0,12 |
| **Protective Life Global Funding** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2020 | | 150 | 150 | 0,18 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | | 100 | 111 | 0,13 |
| **State Street Corp.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 18.08.2020 | | 50 | 51 | 0,06 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 25 | 25 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 16.01.2020 | | 500 | 498 | 0,60 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 2,250 % fällig am 17.06.2019 | | 280 | 280 | 0,34 |
| **Swedbank AB** | | | | |
| 2,200 % fällig am 04.03.2020 | | 1.000 | 989 | 1,19 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2021 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **TIAA Asset Management Finance Co. LLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.11.2019 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 0,856 % fällig am 23.07.2018 | | 100 | 100 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 14.12.2020 | | 200 | 200 | 0,24 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,264 % fällig am 01.06.2020 | | 1.000 | 997 | 1,20 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 200 | 198 | 0,24 |
| **Vereit Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,000 % fällig am 06.02.2019 | | 175 | 169 | 0,20 |
| **Visa, Inc.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 14.12.2020 | | 200 | 200 | 0,24 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Vornado Realty LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.06.2019 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **Wachovia Corp.** | | | | |
| 0,782 % fällig am 15.06.2017 | | 150 | 150 | 0,18 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 07.12.2020 | | 1.100 | 1.095 | 1,32 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.10.2019 | | 25 | 29 | 0,03 |
| | | | 27.203 | 32,76 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | | 100 | 99 | 0,12 |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.04.2020 | € | 100 | 102 | 0,12 |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | $ | 100 | 100 | 0,12 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 28.11.2017 | | 200 | 198 | 0,24 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 05.12.2019 | | 50 | 51 | 0,06 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.05.2020 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Building Materials Corporation of America** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Canadian Pacific Railway Co.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2022 | | 75 | 80 | 0,10 |
| **Cardinal Health, Inc.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.11.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 100 | 99 | 0,12 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 500 | 499 | 0,60 |
| **CNOOC Finance 2011 Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | | 200 | 209 | 0,25 |
| **Delphi Automotive PLC** | | | | |
| 3,150 % fällig am 19.11.2020 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.07.2019 | | 150 | 168 | 0,20 |
| **Dollar Tree, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2020 | | 25 | 26 | 0,03 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **DR Horton, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2017 | $ | 75 | $ 78 | 0,09 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 100 | 93 | 0,11 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 2,550 % fällig am 15.10.2019 | | 100 | 96 | 0,12 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.10.2018 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.01.2017 | | 100 | 99 | 0,12 |
| 2,551 % fällig am 05.10.2018 | | 1.000 | 994 | 1,20 |
| 5,875 % fällig am 02.08.2021 | | 500 | 558 | 0,67 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 10.04.2022 | | 50 | 48 | 0,06 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 5,400 % fällig am 01.11.2020 | | 60 | 66 | 0,08 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | |
| 1,700 % fällig am 27.05.2016 | | 25 | 25 | 0,03 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.11.2020 | | 100 | 99 | 0,12 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 27.04.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.10.2017 | | 25 | 19 | 0,02 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 05.10.2017 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2016 | £ | 50 | 76 | 0,09 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 01.12.2019 | $ | 250 | 232 | 0,28 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | € | 100 | 110 | 0,13 |
| **Lowe's Cos., Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.11.2021 | $ | 50 | 53 | 0,07 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 07.12.2018 | | 200 | 200 | 0,24 |
| **Medtronic, Inc.** | | | | |
| 1,312 % fällig am 15.03.2020 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **NBCUniversal Enterprise, Inc.** | | | | |
| 1,974 % fällig am 15.04.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 04.03.2019 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 11.08.2017 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | | 400 | 370 | 0,45 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2018 | | 50 | 53 | 0,06 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.05.2020 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 400 | 391 | 0,47 |
| **Republic Services, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 275 | 304 | 0,37 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | | 350 | 356 | 0,43 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.10.2025 | | 200 | 196 | 0,24 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2020 | | 100 | 98 | 0,12 |
| **Scripps Networks Interactive, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | € | 100 | 110 | 0,13 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 03.12.2020 | $ | 200 | 199 | 0,24 |
| **Solvay Finance S.A.** | | | | |
| 5,118 % fällig am 29.12.2049 | € | 100 | 108 | 0,13 |
| **Southwest Airlines Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 06.11.2019 | $ | 100 | 101 | 0,12 |
| **Symantec Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2022 | | 100 | 99 | 0,12 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 3,992 % fällig am 16.02.2016 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.11.2017 | | 100 | 104 | 0,13 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2020 | € | 100 | $ 110 | 0,13 |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | $ | 800 | 813 | 0,98 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | | |
| 5,850 % fällig am 01.05.2017 | | 25 | 26 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 01.04.2019 | | 400 | 460 | 0,55 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 1,400 % fällig am 15.12.2017 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 300 | 284 | 0,34 |
| **Viacom, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.12.2021 | | 100 | 98 | 0,12 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 100 | 90 | 0,11 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.04.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 13.11.2020 | | 100 | 100 | 0,12 |
| | | | 10.144 | 12,22 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 30.06.2020 | | 50 | 49 | 0,06 |
| 4,450 % fällig am 15.05.2021 | | 500 | 533 | 0,64 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.12.2020 | | 100 | 106 | 0,13 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 3,561 % fällig am 01.11.2021 | | 1.000 | 1.021 | 1,23 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 23.06.2017 | £ | 50 | 79 | 0,09 |
| **Constellation Energy Group, Inc.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 01.12.2020 | $ | 50 | 54 | 0,07 |
| **Consumers Energy Co.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.05.2022 | | 50 | 49 | 0,06 |
| **Dynegy, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.11.2019 | | 25 | 24 | 0,03 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 200 | 185 | 0,22 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2022 | | 100 | 102 | 0,12 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2021 | | 100 | 90 | 0,11 |
| 3,950 % fällig am 01.09.2022 | | 400 | 349 | 0,42 |
| **Kinder Morgan Finance Co. LLC** | | | | |
| 5,700 % fällig am 05.01.2016 | | 96 | 96 | 0,12 |
| **Laclede Group, Inc.** | | | | |
| 1,112 % fällig am 15.08.2017 | | 40 | 40 | 0,05 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,056 % fällig am 01.09.2017 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.09.2021 | | 100 | 102 | 0,12 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.04.2020 | | 100 | 107 | 0,13 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 100 | 66 | 0,08 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 01.05.2017 | | 35 | 35 | 0,04 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2018 | | 40 | 33 | 0,04 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | | 50 | 50 | 0,06 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 25 | 18 | 0,02 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 07.04.2025 | | 50 | 48 | 0,06 |
| **Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC** | | | | |
| 6,050 % fällig am 15.06.2018 | | 25 | 27 | 0,03 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 1,296 % fällig am 17.06.2019 | | 50 | 50 | 0,06 |
| 3,450 % fällig am 15.03.2021 | | 1.000 | 1.024 | 1,23 |
| | | | 4.387 | 5,28 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 41.734 | 50,26 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | $ | 100 | $ 97 | 0,12 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2017 | | 472 | 484 | 0,58 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 0,625 % fällig am 30.09.2017 | | 8.100 | 8.045 | 9,69 |
| 0,875 % fällig am 30.11.2017 (b) | | 16.650 | 16.603 | 20,00 |
| | | | 25.229 | 30,39 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | | |
| 2,430 % fällig am 18.06.2024 | | 100 | 100 | 0,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.10.2019 | AUD | 435 | 324 | 0,39 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 100 | 18 | 0,02 |
| **Canada Government Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 01.09.2020 | CAD | 1.100 | 793 | 0,95 |
| 1,750 % fällig am 01.03.2019 | | 45 | 34 | 0,04 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,700 % fällig am 01.05.2020 | € | 900 | 986 | 1,19 |
| 1,700 % fällig am 15.09.2018 (a) | | 101 | 116 | 0,14 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 (a) | | 163 | 197 | 0,24 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2021 | | 2.250 | 2.832 | 3,41 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 4,000 % fällig am 02.06.2021 | CAD | 600 | 486 | 0,59 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 1,150 % fällig am 30.07.2020 | € | 3.625 | 4.022 | 4,84 |
| 4,850 % fällig am 31.10.2020 | | 1.075 | 1.396 | 1,68 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.07.2020 | £ | 200 | 303 | 0,37 |
| | | | 11.507 | 13,86 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **Credit Suisse Securities (USA) LLC** | | | | |
| 0,550 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.08.2017 bewertet mit $103. Die Rückkauferlöse betragen $100.) | $ | 100 | 100 | 0,12 |
| **Deutsche Bank Securities, Inc.** | | | | |
| 0,300 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.02.2043 bewertet mit $14.330. Die Rückkauferlöse betragen $14.000.) | | 14.000 | 14.000 | 16,86 |
| | | | 14.100 | 16,98 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 830.160 | 8.303 | 10,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | $ 102.929 | 123,97 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 6 | $ 5 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2017 | 7 | 6 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2018 | 1 | (1) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 6 | (3) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 7 | 2 | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 1 | 1 | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2017 | 4 | 3 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 1 | (3) | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 57 | 2 | 0,00 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 15 | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 10 | 0,01 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 10** | **0,01** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 7.500 | $ (11) | (0,01) |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 4.900 | 19 | 0,02 |
| | | | | $ 8 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,910 % | 20.08.2019 | $ 500 | $ (4) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | £ 300 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,610 % | 07.07.2021 | MXN 1.600 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (4) | 0,00 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 4** | **0,01** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,000 % | 07.12.2016 | $ 500 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,000 % | 08.12.2016 | 900 | 1 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 2 | $ 1 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BPS | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 500 | (1) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 300 | (1) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | 800 | (2) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | JPM | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,000 % | 20.01.2016 | $ 200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,050 % | 17.02.2016 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 1.500 | (3) | (1) | (0,01) |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (9) | $ (4) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | CNH 7,000 | 07.12.2016 | $ 110 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,000 | 07.12.2016 | 110 | (1) | (2) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | GLM | 7,050 | 08.12.2016 | 80 | (1) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,050 | 08.12.2016 | 210 | (3) | (4) | (0,01) |
| | | | | | $ (7) | $ (9) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 28.03.2016 | $ 200 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,670 % | 07.12.2016 | 100 | (1) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,630 % | 08.12.2016 | 200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (3) | $ (2) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Dow Chemical Co. | (1,000 %) | 20.12.2020 | GST | $ 100 | $ (1) | $ (1) | $ 0 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.03.2020 | GST | $ 50 | $ (35) | $ 1 | $ (36) | (0,04) |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 50 | 0 | 1 | (1) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.06.2019 | BPS | 50 | (13) | (4) | (9) | (0,02) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | GST | 100 | (9) | (5) | (4) | (0,01) |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | BRC | € 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.09.2021 | BPS | $ 150 | 1 | 2 | (1) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | € 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 50 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 100 | (3) | (9) | 6 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 50 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (61) | $ (21) | $ (40) | (0,07) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | DUB | BRL 900 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | BPS | 200 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,720 % | 02.01.2018 | GLM | 3.200 | (18) | 1 | (19) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,560 % | 04.01.2021 | DUB | 100 | (2) | 0 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | BPS | 200 | (5) | 0 | (5) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,995 % | 08.12.2020 | BPS | € 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,980 % | 15.12.2020 | DUB | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 1,005 % | 15.12.2020 | GLM | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 1,533 % | 07.11.2016 | MYC | $ 100 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (30) | $ 1 | $ (31) | (0,04) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 387 | $ | 103 | DUB | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 99 | BRL | 387 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 1.098 | $ | 788 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 827 | € | 760 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 520 | $ | 555 | CBK | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| 01/2016 | | 100 | | 107 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.996 | € | 5.460 | HUS | 3 | (68) | (65) | (0,08) |
| 01/2016 | € | 4.208 | $ | 4.484 | HUS | 0 | (87) | (87) | (0,11) |
| 01/2016 | $ | 1.787 | € | 1.629 | JPM | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| 01/2016 | € | 3.021 | $ | 3.280 | UAG | 24 | (26) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 272 | | 410 | MSB | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 18 | INR | 1.224 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 1.213 | $ | 18 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 13.900 | | 114 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 179 | JPY | 21.800 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 7.900 | $ | 65 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 120.514 | | 104 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 169 | | 41 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 259 | | 59 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 448 | | 315 | JPM | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| 02/2016 | | 338 | | 242 | MSB | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 02/2016 | BRL | 387 | | 98 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 268 | | 193 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 450 | | 338 | JPM | 14 | 0 | 14 | 0,02 |
| 02/2016 | € | 5.438 | | 5.912 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 395 | € | 363 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 5.360 | $ | 5.895 | HUS | 68 | 0 | 68 | 0,08 |
| 02/2016 | £ | 99 | | 150 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 7.900 | | 64 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 65 | JPY | 7.900 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 144 | $ | 103 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 3.655 | | 102 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 3.242 | | 99 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 55 | | 3 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 09/2016 | CNH | 693 | | 105 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 09/2016 | | 648 | | 99 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 10/2016 | | 865 | | 132 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | | | | | | $ 147 | $ (237) | $ (90) | (0,11) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (196)** | **(0,24)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 102.747** | **123,75** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 4 | $ 6 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | 12 | 0,02 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 331 | 331 | 0,40 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 103 | 103 | 0,12 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 3 | 3 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 99 | 99 | 0,12 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 12 | 13 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 576** | **0,69** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (20.296)** | **(24,44)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 83.027** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 16.603 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(d) Barmittel in Höhe von USD 285 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(e) Barmittel in Höhe von USD 116 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 8.303 | $ 94.626 | $ 0 | $ 102.929 |
| Finanzderivate[3] | 10 | (192) | 0 | (182) |
| **Summen** | **$ 8.313** | **$ 94.434** | **$ 0** | **$ 102.747** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 311 | $ 8.432 | $ 100 | $ 8.843 |
| Finanzderivate[3] | 3 | 9 | 0 | 12 |
| **Summen** | **$ 314** | **$ 8.441** | **$ 100** | **$ 8.855** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CHF 4 | $ 4 | BRC | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 232 | 234 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 228 | CHF 233 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 3 | $ 3 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 191 | CHF 197 | FBF | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 232 | $ 234 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 228 | CHF 233 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 197 | $ 199 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 229 | CHF 233 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 232 | $ 234 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 235 | CHF 232 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | 235 | 232 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | 199 | 197 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 235 | 232 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | $ 29 | $ (11) | $ 18 | 0,02 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 15 | $ 16 | BPS | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 105 | 114 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 4.552 | € 4.294 | CBK | 113 | 0 | 113 | 0,14 |
| 01/2016 | € 5.136 | $ 5.604 | CBK | 27 | (2) | 25 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 3.414 | € 3.222 | GLM | 86 | 0 | 86 | 0,10 |
| 01/2016 | 4.540 | 4.260 | HUS | 88 | 0 | 88 | 0,11 |
| 01/2016 | € 4.637 | $ 5.096 | HUS | 59 | 0 | 59 | 0,07 |
| 01/2016 | 4.637 | 5.067 | JPM | 30 | 0 | 30 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 1.794 | € 1.632 | MSB | 0 | (21) | (21) | (0,03) |
| 01/2016 | 16 | 15 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 6.013 | 5.640 | UAG | 113 | 0 | 113 | 0,14 |
| 01/2016 | € 4.638 | $ 5.067 | UAG | 28 | 0 | 28 | 0,03 |
| 02/2016 | $ 4.353 | € 3.980 | CBK | 0 | (27) | (27) | (0,03) |
| 02/2016 | 5.100 | 4.637 | HUS | 0 | (59) | (59) | (0,07) |
| 02/2016 | 5.071 | 4.637 | JPM | 0 | (30) | (30) | (0,04) |
| 02/2016 | 5.070 | 4.638 | UAG | 0 | (28) | (28) | (0,03) |
| | | | | $ 544 | $ (167) | $ 377 | 0,46 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 2.248 | £ 1.494 | BPS | $ 0 | $ (46) | $ (46) | (0,06) |
| 01/2016 | £ 32 | $ 47 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.764 | 2.617 | CBK | 18 | 0 | 18 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 2.663 | £ 1.763 | CBK | 0 | (65) | (65) | (0,08) |
| 01/2016 | 2.660 | 1.764 | DUB | 0 | (59) | (59) | (0,07) |
| 01/2016 | £ 1.756 | $ 2.606 | JPM | 18 | 0 | 18 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 2.655 | £ 1.761 | MSB | 0 | (59) | (59) | (0,07) |
| 01/2016 | £ 1.756 | $ 2.600 | MSB | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| 01/2016 | 1.506 | 2.229 | SCX | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 02/2016 | $ 2.607 | £ 1.756 | CBK | 0 | (18) | (18) | (0,02) |
| 02/2016 | 2.607 | 1.756 | JPM | 0 | (18) | (18) | (0,02) |
| 02/2016 | 2.601 | 1.756 | MSB | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| 02/2016 | 2.229 | 1.506 | SCX | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | | | | $ 56 | $ (286) | $ (230) | (0,28) |

**(h) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| DEU | (2,000 %) | 31.12.2015 | 04.01.2016 | $ 14.032 | $ (14.031) | (16,90) |
| DEU | 0,600 % | 28.12.2015 | 11.01.2016 | 2.594 | (2.594) | (3,12) |
| | | | | | $ (16.625) | (20,02) |

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BPS | $ (63) | $ 0 | $ (63) |
| BRC | (4) | 0 | (4) |
| CBK | 30 | 0 | 30 |
| DUB | (50) | (10) | (60) |
| FBF | 5 | 0 | 5 |
| GLM | 64 | 0 | 64 |
| GST | (45) | 0 | (45) |
| HUS | 2 | 0 | 2 |
| JPM | (6) | 0 | (6) |
| MSB | (76) | 0 | (76) |
| MYC | (4) | 0 | (4) |
| SCX | (3) | 0 | (3) |
| UAG | 119 | 0 | 119 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 123,97 | 106,08 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,01 | 0,03 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,01 | (0,22) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,24) | 0,33 |

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.699.605 | $ 17.003 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes 0,875 % fällig am 30.11.2017 | $ | 16.650 | 16.608 |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.09.2017 | | 9.050 | 9.052 |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.11.2020 | | 4.850 | 4.824 |
| Spain Government Bond 1,150 % fällig am 30.07.2020 | € | 3.980 | 4.480 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.09.2020 | $ | 3.325 | 3.330 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,750 % fällig am 01.05.2021 | € | 2.250 | 2.842 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2020 | $ | 1.600 | 1.593 |
| Spain Government Bond 4,850 % fällig am 31.10.2020 | € | 1.075 | 1.428 |
| Bear Stearns Cos. LLC 7,250 % fällig am 01.02.2018 | $ | 1.200 | 1.324 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.200 | 1.200 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 1.000 | 1.102 |
| Wells Fargo & Co. 2,550 % fällig am 07.12.2020 | | 1.100 | 1.093 |
| Citigroup, Inc. 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 1.100 | 1.090 |
| BP Capital Markets PLC 3,561 % fällig am 01.11.2021 | | 1.000 | 1.023 |
| Verizon Communications, Inc. 3,450 % fällig am 15.03.2021 | | 1.000 | 1.021 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,700 % fällig am 01.05.2020 | € | 900 | 1.015 |
| BNP Paribas S.A. 2,700 % fällig am 20.08.2018 | $ | 1.000 | 1.014 |
| UBS AG 1,264 % fällig am 01.06.2020 | | 1.000 | 997 |
| American Express Credit Corp. 1,800 % fällig am 31.07.2018 | | 1.000 | 997 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 900.519 | $ 9.010 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 30.11.2020 | $ | 4.850 | 4.830 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.09.2020 | | 3.325 | 3.302 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2020 | | 1.600 | 1.577 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.200 | 1.200 |
| US Treasury Notes 1,000 % fällig am 15.09.2017 | | 1.150 | 1.155 |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 30.09.2017 | | 950 | 944 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 19.01.2016 | | 900 | 900 |
| US Treasury Notes 1,250 % fällig am 31.01.2020 | | 850 | 842 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.01.2016 | | 600 | 600 |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2019 | £ | 300 | 472 |
| US Treasury Notes 2,000 % fällig am 15.08.2025 | $ | 450 | 448 |
| Spain Government Bond 1,150 % fällig am 30.07.2020 | € | 355 | 394 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 05.06.2015 | $ | 300 | 300 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 300 | 300 |
| Province of Ontario Canada 2,600 % fällig am 02.06.2025 | CAD | 400 | 296 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.08.2020 | $ | 250 | 247 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 204 | 203 |
| Chevron Corp. 2,419 % fällig am 17.11.2020 | | 200 | 201 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,000 % fällig am 01.09.2020 | € | 150 | 188 |

(a) Der Low Duration Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **KANADA** | | | |
| TransCanada Corp. | 15.000 | $ 488 | 0,69 |
| **USA** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| ONE Gas, Inc. | 50.000 | 2.509 | 3,56 |
| Tallgrass Energy GP LP | 43.900 | 701 | 1,00 |
| | | 3.210 | 4,56 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | |
| Cheniere Energy, Inc. | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2045 | $ 500 | 261 | 0,37 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| Buckeye Partners LP | | | |
| 5,850 % fällig am 15.11.2043 | 250 | 193 | 0,27 |
| Energy Transfer Partners LP | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2042 | 675 | 551 | 0,78 |
| EQT Midstream Partners LP | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | $ 1.200 | $ 991 | 1,41 |
| Kinder Morgan Energy Partners LP | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2043 | 400 | 297 | 0,42 |
| NuStar Logistics LP | | | |
| 6,750 % fällig am 01.02.2021 | 1.000 | 945 | 1,34 |
| Rockies Express Pipeline LLC | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | 1.200 | 1.146 | 1,63 |
| | | 4.123 | 5,85 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| Fannie Mae | | | |
| 0,225 % fällig am 14.01.2016 - 03.02.2016 | 2.300 | 2.300 | 3,26 |
| 0,260 % fällig am 08.02.2016 - 17.02.2016 | 7.300 | 7.298 | 10,36 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,185 % fällig am 29.01.2016 | 1.900 | 1.900 | 2,70 |
| 0,190 % fällig am 06.01.2016 | 4.500 | 4.500 | 6,39 |
| 0,232 % fällig am 22.01.2016 | 5.700 | 5.699 | 8,09 |
| 0,236 % fällig am 27.01.2016 | 4.100 | 4.100 | 5,82 |
| 0,240 % fällig am 25.01.2016 | 3.000 | 3.000 | 4,26 |
| 0,245 % fällig am 20.01.2016 | 2.400 | 2.400 | 3,40 |
| 0,279 % fällig am 26.01.2016 | $ 2.500 | $ 2.500 | 3,55 |
| 0,310 % fällig am 28.01.2016 | 3.500 | 3.500 | 4,97 |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | 8.700 | 8.697 | 12,34 |
| 0,380 % fällig am 01.02.2016 - 09.02.2016 | 4.400 | 4.399 | 6,24 |
| Freddie Mac | | | |
| 0,170 % fällig am 28.01.2016 | 200 | 200 | 0,28 |
| 0,250 % fällig am 27.01.2016 | 1.000 | 1.000 | 1,42 |
| 0,280 % fällig am 22.02.2016 | 1.400 | 1.399 | 1,99 |
| | | 52.892 | 75,07 |
| Summe USA | | 60.486 | 85,85 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 683.869 | 6.840 | 9,71 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 67.814** | **96,25** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE**

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Alerian MLP Total Return Index | 9.594 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 9.220 | 15.06.2016 | BOA | $ 1.367 | $ 1 | $ 1.366 | 1,94 |
| Erhalt | Energy Transfer Partners LP | 73.764 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.166 | 15.11.2016 | BPS | 321 | 0 | 321 | 0,45 |
| Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 194.497 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.361 | 15.11.2016 | BPS | 614 | (1) | 615 | 0,87 |
| Erhalt | Sunoco LP | 68.649 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.474 | 15.11.2016 | BPS | 245 | 0 | 245 | 0,35 |
| Erhalt | Targa Resources Partners LP | 42.114 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 678 | 15.11.2016 | BPS | 18 | 0 | 18 | 0,03 |
| Erhalt | Sunoco LP | 10.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 360 | 15.12.2016 | BPS | 36 | 0 | 36 | 0,05 |
| Erhalt | EnLink Midstream Partners LP | 90.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.492 | 29.07.2016 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | Boardwalk Pipeline Partners LP | 50.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 550 | 15.11.2016 | CBK | 99 | 0 | 99 | 0,14 |
| Erhalt | Buckeye Partners LP | 39.858 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.268 | 15.11.2016 | CBK | 360 | 0 | 360 | 0,51 |
| Erhalt | Cheniere Energy Partners LP | 101.272 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.220 | 15.11.2016 | CBK | 420 | 0 | 420 | 0,60 |
| Erhalt | Columbia Pipeline Partners LP | 20.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 303 | 15.11.2016 | CBK | 46 | 0 | 46 | 0,07 |
| Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 15.476 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 111 | 15.11.2016 | CBK | 32 | 0 | 32 | 0,04 |
| Erhalt | Enbridge Energy Partners LP | 96.343 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.972 | 15.11.2016 | CBK | 250 | 0 | 250 | 0,35 |
| Erhalt | Energy Transfer Equity LP | 35.684 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 468 | 15.11.2016 | CBK | 22 | 0 | 22 | 0,03 |
| Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 43.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.002 | 15.11.2016 | CBK | 98 | 0 | 98 | 0,14 |
| Erhalt | EQT Midstream Partners LP | 30.700 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.062 | 15.11.2016 | CBK | 254 | 1 | 253 | 0,36 |
| Erhalt | Genesis Energy LP | 45.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.441 | 15.11.2016 | CBK | 212 | 1 | 211 | 0,30 |
| Erhalt | MPLX LP | 76.196 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.275 | 15.11.2016 | CBK | 730 | (1) | 731 | 1,04 |
| Erhalt | NuStar Energy LP | 19.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 640 | 15.11.2016 | CBK | 122 | 0 | 122 | 0,17 |
| Erhalt | NuStar GP Holdings LLC | 12.178 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 217 | 15.11.2016 | CBK | 41 | 0 | 41 | 0,06 |
| Erhalt | ONEOK Partners LP | 89.391 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.107 | 15.11.2016 | CBK | 586 | 1 | 585 | 0,83 |
| Erhalt | Phillips 66 Partners LP | 18.003 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 951 | 15.11.2016 | CBK | 154 | 0 | 154 | 0,22 |
| Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 95.905 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.989 | 15.11.2016 | CBK | 226 | 0 | 226 | 0,32 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Prämien Gezahlt/(erhalten) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Shell Midstream Partners LP | 15.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 503 | 15.11.2016 | CBK | $ 119 | $ 0 | $ 119 | 0,17 |
| Erhalt | Tallgrass Energy Partners LP | 44.399 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.532 | 15.11.2016 | CBK | 297 | 0 | 297 | 0,42 |
| Erhalt | Tesoro Logistics LP | 34.259 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.471 | 15.11.2016 | CBK | 252 | 0 | 252 | 0,36 |
| Erhalt | Valero Energy Partners LP | 3.652 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 165 | 15.11.2016 | CBK | 23 | 0 | 23 | 0,03 |
| Erhalt | Western Gas Partners LP | 26.762 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.007 | 15.11.2016 | CBK | 265 | 0 | 265 | 0,38 |
| Erhalt | Williams Partners LP | 76.562 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.762 | 15.11.2016 | CBK | 370 | 0 | 370 | 0,52 |
| Erhalt | Magellan Midstream Partners LP | 39.994 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.396 | 15.11.2016 | DUB | 320 | 0 | 320 | 0,45 |
| Erhalt | Cedar Fair LP | 11.100 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 601 | 15.11.2016 | FBF | 18 | 0 | 18 | 0,03 |
| Erhalt | Spectra Energy Partners LP | 40.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.580 | 15.11.2016 | FBF | 328 | 0 | 328 | 0,47 |
| Erhalt | TC PipeLines LP | 26.752 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.110 | 15.11.2016 | FBF | 220 | 0 | 220 | 0,31 |
| | | | | | | | $ 8.465 | $ 2 | $ 8.463 | 12,01 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 2.548 | CAD | 3.539 | BOA | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 698 | $ | 501 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.841 | | 2.134 | MSB | 89 | 0 | 89 | 0,13 |
| 02/2016 | | 3.539 | | 2.549 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.019 | CAD | 2.681 | MSB | 0 | (89) | (89) | (0,13) |
| | | | | | | $ 90 | $ (91) | $ (1) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 8.464** | **12,01** |
| **Summe Anlagen** | **$ 76.278** | **108,26** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | $ 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 15 | 15 | 0,02 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 409 | 409 | 0,58 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 5 | 5 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 127 | 127 | 0,18 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 123 | 123 | 0,18 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 0 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 3 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 684** | **0,97** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (6.504)** | **(9,23)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 70.458** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

**(b) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 10.538 | $ 57.276 | $ 0 | $ 67.814 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 8.464 | 0 | 8.464 |
| **Summen** | **$ 10.538** | **$ 65.740** | **$ 0** | **$ 76.278** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14.348 | $ 62.386 | $ 0 | $ 76.734 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 3.152 | 0 | 3.152 |
| **Summen** | **$ 14.348** | **$ 65.538** | **$ 0** | **$ 79.886** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(c) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 359 | € 337 | BOA | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,01 |
| 01/2016 | € 492 | $ 541 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 01/2016 | 49 | 54 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 68 | 74 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 420 | € 394 | CBK | 9 | (1) | 8 | 0,01 |
| 01/2016 | € 139 | $ 151 | CBK | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 592 | € 543 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | € 492 | $ 541 | HUS | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 354 | € 332 | HUS | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| 01/2016 | € 298 | $ 326 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 6 | € 5 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 17 | 15 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 357 | 336 | UAG | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 01/2016 | € 493 | $ 539 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 541 | € 492 | BOA | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | 541 | 492 | HUS | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | 522 | 477 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | 481 | 440 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | $ 48 | $ (23) | $ 25 | 0,04 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 300 | £ 200 | AZD | $ 0 | $ (6) | $ (6) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 260 | $ 392 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 229 | £ 151 | BOA | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 01/2016 | 1.150 | 764 | BPS | 0 | (24) | (24) | (0,03) |
| 01/2016 | £ 137 | $ 207 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| 01/2016 | 144 | 212 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 893 | 1.328 | CBK | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 1.154 | £ 764 | CBK | 0 | (28) | (28) | (0,04) |
| 01/2016 | 1.155 | 766 | DUB | 0 | (26) | (26) | (0,04) |
| 01/2016 | 19 | 13 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 836 | $ 1.240 | JPM | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 1.138 | £ 755 | MSB | 0 | (25) | (25) | (0,04) |
| 01/2016 | £ 836 | $ 1.237 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| 01/2016 | 469 | 695 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 21 | £ 14 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 1.144 | 771 | CBK | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| 02/2016 | 1.709 | 1.150 | JPM | 0 | (13) | (13) | (0,02) |
| 02/2016 | 1.238 | 836 | MSB | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| 02/2016 | 695 | 469 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | $ 43 | $ (145) | $ (102) | (0,15) |

**(d) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (6) | $ 0 | $ (6) |
| BOA | 1.377 | (1.090) | 287 |
| BPS | 1.216 | (880) | 336 |
| BRC | 0 | 0 | 0 |
| CBK | 4.962 | (3.580) | 1.382 |
| DUB | 294 | (400) | (106) |
| FBF | 566 | (300) | 266 |
| GLM | (2) | 0 | (2) |
| HUS | 7 | 0 | 7 |
| JPM | (8) | 0 | (8) |
| MSB | (26) | 0 | (26) |
| UAG | 7 | 0 | 7 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(e) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 96,25 | 99,05 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 12,01 | 4,07 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,085 % fällig am 17.09.2015 | $ 17.300 | $ 17.297 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,093 % fällig am 14.10.2015 | 15.500 | 15.496 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,236 % fällig am 27.01.2016 | 15.200 | 15.196 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,098 % fällig am 09.11.2015 | 14.500 | 14.495 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | 11.900 | 11.897 |
| | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | 1.151.714 | 11.524 |
| | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,000 % fällig am 17.08.2015 | $ 9.800 | 9.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,095 % fällig am 02.09.2015 | 9.700 | 9.697 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,070 % fällig am 22.05.2015 | 9.600 | 9.599 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,084 % fällig am 22.07.2015 | 9.100 | 9.098 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | 8.700 | 8.696 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,260 % fällig am 10.02.2016 | 8.200 | 8.190 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,068 % fällig am 05.06.2015 | 8.100 | 8.099 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,072 % fällig am 13.05.2015 | 7.800 | 7.799 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,260 % fällig am 08.02.2016 | 7.700 | 7.691 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,245 % fällig am 20.01.2016 | 7.600 | 7.593 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,091 % fällig am 09.10.2015 | 7.300 | 7.298 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,081 % fällig am 17.07.2015 | 7.200 | 7.199 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,190 % fällig am 06.01.2016 | 7.000 | 6.999 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,185 % fällig am 29.01.2016 | 7.000 | 6.998 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,225 % fällig am 14.01.2016 | 6.600 | 6.594 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,154 % fällig am 18.11.2015 | 6.500 | 6.495 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,232 % fällig am 22.01.2016 | 5.700 | 5.698 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,090 % fällig am 15.09.2015 | 4.800 | 4.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,086 % fällig am 18.09.2015 | 4.700 | 4.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,094 % fällig am 29.04.2015 | 4.700 | 4.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,075 % fällig am 31.07.2015 | 4.300 | 4.299 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,113 % fällig am 13.03.2015 | 4.000 | 4.000 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,085 % fällig am 17.09.2015 | $ 17.300 | $ 17.298 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,093 % fällig am 14.10.2015 | 15.500 | 15.497 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,094 % fällig am 29.04.2015 | 14.800 | 14.800 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,098 % fällig am 09.11.2015 | 14.500 | 14.495 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | 11.900 | 11.898 |
| | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | 1.159.293 | 11.600 |
| | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,236 % fällig am 27.01.2016 | $ 11.100 | 11.099 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,000 % fällig am 17.08.2015 | 9.800 | 9.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,095 % fällig am 02.09.2015 | 9.700 | 9.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,070 % fällig am 22.05.2015 | 9.600 | 9.600 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,084 % fällig am 22.07.2015 | 9.100 | 9.100 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,068 % fällig am 05.06.2015 | 8.100 | 8.100 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,072 % fällig am 13.05.2015 | 7.400 | 7.400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,091 % fällig am 09.10.2015 | 7.300 | 7.299 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,081 % fällig am 17.07.2015 | 7.200 | 7.200 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,154 % fällig am 18.11.2015 | 6.500 | 6.498 |
| **US Treasury Bills** | | |
| 0,065 % fällig am 28.05.2015 | 6.000 | 6.000 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,245 % fällig am 20.01.2016 | 5.200 | 5.196 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,185 % fällig am 29.01.2016 | 5.100 | 5.098 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,225 % fällig am 14.01.2016 | 5.000 | 4.999 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,090 % fällig am 15.09.2015 | 4.800 | 4.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,113 % fällig am 13.03.2015 | 4.700 | 4.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,086 % fällig am 18.09.2015 | 4.700 | 4.700 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,260 % fällig am 10.02.2016 | 4.700 | 4.696 |
| **Fannie Mae** | | |
| 0,260 % fällig am 08.02.2016 | 4.500 | 4.496 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,075 % fällig am 31.07.2015 | 4.300 | 4.300 |
| **US Treasury Bills** | | |
| 0,061 % fällig am 14.05.2015 | 4.000 | 4.000 |
| **Freddie Mac** | | |
| 0,085 % fällig am 09.03.2015 | 3.600 | 3.600 |
| **Freddie Mac** | | |
| 0,230 % fällig am 12.01.2016 | 3.500 | 3.499 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,075 % fällig am 06.05.2015 | 3.400 | 3.400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | |
| 0,080 % fällig am 29.07.2015 | 3.400 | 3.400 |

(a) Der PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **BRASILIEN** | | | |
| AMBEV S.A. | 3.400 | $ 15 | 0,20 |
| Banco Bradesco S.A. | 9.592 | 46 | 0,60 |
| Banco do Brasil S.A. | 17.200 | 64 | 0,83 |
| BM&FBovespa S.A. - Bolsa de Valores Mercadorias e Futuros | 3.200 | 9 | 0,11 |
| BRF S.A. | 200 | 3 | 0,04 |
| CCR S.A. | 2.400 | 8 | 0,10 |
| Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo | 7.143 | 33 | 0,43 |
| Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA | 1.100 | 4 | 0,06 |
| Cia Energetica de Minas Gerais | 33.058 | 50 | 0,64 |
| Cia Siderurgica Nacional S.A. | 36.025 | 35 | 0,46 |
| CPFL Energia S.A. | 3.705 | 27 | 0,36 |
| EDP - Energias do Brasil S.A. | 7.800 | 24 | 0,31 |
| Embraer S.A. | 163 | 5 | 0,06 |
| Fibria Celulose S.A. | 694 | 9 | 0,11 |
| Gerdau S.A. | 20.413 | 25 | 0,32 |
| JBS S.A. | 3.900 | 12 | 0,16 |
| Light S.A. | 3.300 | 8 | 0,11 |
| Lojas Renner S.A. | 500 | 2 | 0,03 |
| Marfrig Global Foods S.A. | 5.500 | 9 | 0,11 |
| Natura Cosmeticos S.A. | 3.800 | 22 | 0,29 |
| Petroleo Brasileiro S.A. | 3.600 | 15 | 0,20 |
| Rumo Logistica Operadora Multimodal S.A. | 1.230 | 2 | 0,02 |
| Sul America S.A. | 2.900 | 14 | 0,18 |
| Telefonica Brasil S.A. | 4.584 | 41 | 0,54 |
| Tim Participacoes S.A. | 1.787 | 15 | 0,20 |
| Tractebel Energia S.A. | 2.400 | 20 | 0,26 |
| Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A. | 1.600 | 7 | 0,09 |
| Ultrapar Participacoes S.A. | 200 | 3 | 0,04 |
| | | 527 | 6,86 |
| **CHINA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| GOME Electrical Appliances Holding Ltd. | 40.000 | 6 | 0,08 |
| Great Wall Motor Co. Ltd. | 2.500 | 3 | 0,04 |
| | | 9 | 0,12 |
| **ENERGY** | | | |
| China Petroleum & Chemical Corp. | 138.000 | 83 | 1,08 |
| China Shenhua Energy Co. Ltd. | 19.000 | 30 | 0,39 |
| CNOOC Ltd. | 82.000 | 85 | 1,11 |
| Inner Mongolia Yitai Coal Co. Ltd. | 18.200 | 16 | 0,21 |
| PetroChina Co. Ltd. | 42.000 | 28 | 0,36 |
| Yanzhou Coal Mining Co. Ltd. | 6.000 | 3 | 0,04 |
| | | 245 | 3,19 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Agile Property Holdings Ltd. | 44.000 | 24 | 0,32 |
| Agricultural Bank of China Ltd. | 199.000 | 81 | 1,05 |
| Bank of China Ltd. | 438.000 | 194 | 2,53 |
| Bank of Communications Co. Ltd. | 65.000 | 46 | 0,59 |
| China CITIC Bank Corp. Ltd. | 36.000 | 23 | 0,30 |
| China Construction Bank Corp. | 414.000 | 282 | 3,68 |
| China Everbright Bank Co. Ltd. | 24.000 | 12 | 0,15 |
| China Life Insurance Co. Ltd. | 10.000 | 32 | 0,42 |
| China Merchants Bank Co. Ltd. | 20.500 | 48 | 0,63 |
| China Minsheng Banking Corp. Ltd. | 24.000 | 24 | 0,31 |
| China Vanke Co. Ltd. | 2.100 | 6 | 0,08 |
| Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. | 24.000 | $ 14 | 0,19 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. | 24.000 | 10 | 0,13 |
| Dalian Wanda Commercial Properties Co. Ltd. | 1.600 | 9 | 0,12 |
| Evergrande Real Estate Group Ltd. | 62.000 | 54 | 0,71 |
| Guangzhou R&F Properties Co. Ltd. | 30.800 | 38 | 0,49 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. | 393.000 | 236 | 3,07 |
| New China Life Insurance Co. Ltd. | 2.800 | 12 | 0,15 |
| People's Insurance Co. Group of China Ltd. | 8.000 | 4 | 0,05 |
| PICC Property & Casualty Co. Ltd. | 4.000 | 8 | 0,10 |
| Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. | 6.500 | 36 | 0,47 |
| Sino-Ocean Land Holdings Ltd. | 7.000 | 4 | 0,06 |
| SOHO China Ltd. | 39.000 | 19 | 0,25 |
| | | 1.216 | 15,85 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| China Communications Construction Co. Ltd. | 12.000 | 12 | 0,16 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Lenovo Group Ltd. | 6.000 | 6 | 0,08 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| China National Building Material Co. Ltd. | 62.000 | 30 | 0,38 |
| Jiangxi Copper Co. Ltd. | 3.000 | 3 | 0,05 |
| | | 33 | 0,43 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| China Telecom Corp. Ltd. | 160.000 | 75 | 0,97 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Huaneng Power International, Inc. | 16.000 | 14 | 0,18 |
| Summe China | | 1.610 | 20,98 |
| **GRIECHENLAND** | | | |
| Hellenic Telecommunications Organization S.A. | 340 | 3 | 0,04 |
| **HONGKONG** | | | |
| BOC Hong Kong Holdings Ltd. | 5.000 | 15 | 0,20 |
| China Mobile Ltd. | 19.500 | 219 | 2,86 |
| China Overseas Land & Investment Ltd. | 2.000 | 7 | 0,09 |
| China Power International Development Ltd. | 8.000 | 5 | 0,06 |
| China Resources Beer Holdings Co. Ltd. | 16.000 | 34 | 0,45 |
| China Resources Land Ltd. | 2.000 | 6 | 0,08 |
| China Resources Power Holdings Co. Ltd. | 6.000 | 12 | 0,15 |
| China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd. | 7.200 | 22 | 0,29 |
| China Unicom Hong Kong Ltd. | 58.000 | 70 | 0,91 |
| Poly Property Group Co. Ltd. | 48.000 | 15 | 0,20 |
| Shanghai Industrial Holdings Ltd. | 3.000 | 8 | 0,10 |
| | | 413 | 5,39 |
| **INDIEN** | | | |
| Infosys Ltd. | 1.783 | 30 | 0,39 |
| Reliance Industries Ltd. | 510 | 15 | 0,21 |
| State Bank of India | 1.010 | 34 | 0,44 |
| Tata Motors Ltd. | 574 | $ 17 | 0,22 |
| Vedanta Resources PLC | 2.702 | 11 | 0,14 |
| | | 107 | 1,40 |
| **INDONESIEN** | | | |
| Adaro Energy Tbk PT | 133.000 | 5 | 0,06 |
| Astra International Tbk PT | 44.000 | 19 | 0,25 |
| Bank Central Asia Tbk PT | 9.000 | 9 | 0,11 |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT | 17.000 | 11 | 0,15 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | 22.000 | 8 | 0,10 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 10.500 | 9 | 0,11 |
| Indofood Sukses Makmur Tbk PT | 10.000 | 4 | 0,05 |
| Perusahaan Gas Negara Persero Tbk PT | 44.000 | 9 | 0,11 |
| Semen Indonesia Persero Tbk PT | 5.500 | 4 | 0,06 |
| Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT | 228.500 | 51 | 0,67 |
| United Tractors Tbk PT | 3.500 | 4 | 0,06 |
| | | 133 | 1,73 |
| **MEXIKO** | | | |
| Alfa SAB de C.V. | 2.500 | 5 | 0,06 |
| America Movil SAB de C.V. | 7.977 | 112 | 1,46 |
| Cemex SAB de C.V. | 4.199 | 23 | 0,31 |
| Empresas ICA SAB de C.V. | 6.400 | 1 | 0,02 |
| Fomento Economico Mexicano SAB de C.V. | 106 | 10 | 0,13 |
| Fresnillo PLC | 455 | 5 | 0,06 |
| Grupo Aeromexico SAB de C.V. | 3.100 | 7 | 0,09 |
| Grupo Bimbo SAB de C.V. | 3.800 | 10 | 0,13 |
| Grupo Financiero Inbursa SAB de C.V. | 2.200 | 4 | 0,05 |
| Grupo Financiero Santander Mexico SAB de C.V. | 3.200 | 28 | 0,36 |
| Grupo Mexico SAB de C.V. | 1.800 | 4 | 0,05 |
| Grupo Televisa SAB | 127 | 4 | 0,05 |
| Industrias Penoles SAB de C.V. | 295 | 3 | 0,04 |
| Kimberly-Clark de Mexico SAB de C.V. | 2.300 | 5 | 0,07 |
| Wal-Mart de Mexico SAB de C.V. | 6.300 | 16 | 0,21 |
| | | 237 | 3,09 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| Steinhoff International Holdings NV | 1.850 | 9 | 0,12 |
| **PERU** | | | |
| Southern Copper Corp. | 164 | 4 | 0,06 |
| **POLEN** | | | |
| Asseco Poland S.A. | 317 | 5 | 0,06 |
| Bank Pekao S.A. | 110 | 4 | 0,05 |
| Enea S.A. | 1.210 | 4 | 0,05 |
| Energa S.A. | 937 | 3 | 0,04 |
| KGHM Polska Miedz S.A. | 1.800 | 29 | 0,38 |
| Orange Polska S.A. | 13.500 | 22 | 0,29 |
| PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. | 6.940 | 22 | 0,29 |
| PKP Cargo S.A. | 218 | 4 | 0,05 |
| Polski Koncern Naftowy Orlen S.A. | 2.530 | 43 | 0,56 |
| Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A. | 7.110 | 9 | 0,12 |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. | 2.070 | 14 | 0,19 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. | 580 | 5 | 0,06 |
| Tauron Polska Energia S.A. | 17.110 | 13 | 0,16 |
| | | 177 | 2,30 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **RUSSLAND** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| X5 Retail Group NV | 320 | $ 6 | 0,08 |
| **ENERGY** | | | |
| Gazprom Neft PAO | 520 | 6 | 0,07 |
| Gazprom PAO | 64.400 | 239 | 3,12 |
| Rosneft OAO | 19.660 | 69 | 0,89 |
| Surgutneftegas OAO | 36.460 | 169 | 2,21 |
| Tatneft PAO | 1.369 | 36 | 0,47 |
| | | 519 | 6,76 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Sberbank of Russia | 4.050 | 24 | 0,31 |
| VTB Bank PJSC | 4.000 | 8 | 0,11 |
| | | 32 | 0,42 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aeroflot - Russian Airlines PJSC | 23.100 | 18 | 0,23 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alrosa PAO | 4.342 | 3 | 0,04 |
| Mechel | 10.726 | 9 | 0,12 |
| MMC Norilsk Nickel PJSC | 6.910 | 88 | 1,14 |
| PhosAgro OAO | 754 | 10 | 0,13 |
| Severstal PAO | 1.960 | 16 | 0,21 |
| | | 126 | 1,64 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| MegaFon PJSC | 2.312 | 27 | 0,35 |
| Mobile TeleSystems PJSC | 13.810 | 40 | 0,52 |
| Rostelecom PJSC | 12.420 | 15 | 0,20 |
| Sistema JSFC | 3.130 | 18 | 0,24 |
| | | 100 | 1,31 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Federal Grid Co. Unified Energy System PJSC | 4.540.000 | 4 | 0,05 |
| Lukoil PJSC | 6.110 | 198 | 2,58 |
| | | 202 | 2,63 |
| Summe Russland | | 1.003 | 13,07 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| AngloGold Ashanti Ltd. | 5.149 | 37 | 0,48 |
| Aveng Ltd. | 10.450 | 2 | 0,02 |
| Barclays Africa Group Ltd. | 4.677 | 43 | 0,56 |
| Barloworld Ltd. | 3.443 | 14 | 0,18 |
| Bidvest Group Ltd. | 540 | 11 | 0,15 |
| Exxaro Resources Ltd. | 2.210 | 6 | 0,08 |
| FirstRand Ltd. | 7.540 | 21 | 0,27 |
| Foschini Group Ltd. | 1.032 | 8 | 0,11 |
| Gold Fields Ltd. | 26.700 | 74 | 0,96 |
| Impala Platinum Holdings Ltd. | 6.550 | 11 | 0,14 |
| Imperial Holdings Ltd. | 740 | 6 | 0,08 |
| Investec Ltd. | 553 | 4 | 0,05 |
| Kumba Iron Ore Ltd. | 4.040 | 11 | 0,14 |
| Liberty Holdings Ltd. | 2.170 | 16 | 0,21 |
| MMI Holdings Ltd. | 2.060 | 3 | 0,04 |
| Mr Price Group Ltd. | 250 | 3 | 0,04 |
| MTN Group Ltd. | 8.670 | 75 | 0,97 |
| Nampak Ltd. | 5.397 | 9 | 0,11 |
| Nedbank Group Ltd. | 1.310 | 16 | 0,21 |
| Netcare Ltd. | 1.600 | 3 | 0,05 |
| PPC Ltd. | 7.130 | 7 | 0,09 |
| Reunert Ltd. | 922 | 4 | 0,05 |
| Sanlam Ltd. | 7.017 | 27 | 0,36 |
| Sappi Ltd. | 4.030 | 17 | 0,22 |
| Sasol Ltd. | 2.570 | $ 69 | 0,90 |
| Shoprite Holdings Ltd. | 367 | 3 | 0,04 |
| Sibanye Gold Ltd. | 16.009 | 24 | 0,32 |
| Standard Bank Group Ltd. | 10.410 | 76 | 0,99 |
| Telkom S.A. SOC Ltd. | 6.700 | 28 | 0,36 |
| Tiger Brands Ltd. | 220 | 5 | 0,06 |
| Truworths International Ltd. | 707 | 4 | 0,05 |
| Vodacom Group Ltd. | 1.570 | 15 | 0,20 |
| Woolworths Holdings Ltd. | 618 | 4 | 0,05 |
| | | 656 | 8,54 |
| **SÜDKOREA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hankook Tire Co. Ltd. | 290 | 11 | 0,15 |
| Hyundai Department Store Co. Ltd. | 38 | 4 | 0,05 |
| Hyundai Mobis Co. Ltd. | 43 | 9 | 0,12 |
| Kia Motors Corp. | 1.022 | 46 | 0,59 |
| LG Electronics, Inc. | 1.391 | 63 | 0,83 |
| Lotte Shopping Co. Ltd. | 59 | 12 | 0,15 |
| | | 145 | 1,89 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| E-MART, Inc. | 72 | 12 | 0,15 |
| KT&G Corp. | 69 | 6 | 0,08 |
| | | 18 | 0,23 |
| **ENERGY** | | | |
| GS Holdings Corp. | 350 | 15 | 0,20 |
| SK Innovation Co. Ltd. | 290 | 32 | 0,41 |
| S-Oil Corp. | 102 | 7 | 0,09 |
| | | 54 | 0,70 |
| **FINANCIALS** | | | |
| DGB Financial Group, Inc. | 730 | 6 | 0,08 |
| Dongbu Insurance Co. Ltd. | 90 | 5 | 0,07 |
| Hana Financial Group, Inc. | 580 | 12 | 0,15 |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd. | 2.240 | 14 | 0,18 |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. | 570 | 18 | 0,23 |
| Industrial Bank of Korea | 2.320 | 24 | 0,31 |
| KB Financial Group, Inc. | 1.140 | 32 | 0,42 |
| Mirae Asset Life Insurance Co. Ltd. | 1.083 | 5 | 0,06 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 20 | 5 | 0,07 |
| Samsung Life Insurance Co. Ltd. | 395 | 37 | 0,48 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. | 1.460 | 49 | 0,64 |
| Tongyang Life Insurance Co. Ltd. | 620 | 6 | 0,08 |
| Woori Bank | 6.735 | 50 | 0,66 |
| | | 263 | 3,43 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| CJ Corp. | 143 | 31 | 0,40 |
| Doosan Heavy Industries & Construction Co. Ltd. | 470 | 8 | 0,11 |
| Doosan Infracore Co. Ltd. | 1.420 | 6 | 0,07 |
| Korean Air Lines Co. Ltd. | 430 | 10 | 0,13 |
| LS Corp. | 362 | 12 | 0,16 |
| SK Holdings Co. Ltd. | 227 | 46 | 0,60 |
| SK Networks Co. Ltd. | 1.340 | 6 | 0,08 |
| | | 119 | 1,55 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| LG Display Co. Ltd. | 1.110 | 23 | 0,30 |
| Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. | 106 | 6 | 0,07 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 237 | 253 | 3,30 |
| SK Hynix, Inc. | 130 | 3 | 0,04 |
| | | 285 | 3,71 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Hyosung Corp. | 87 | $ 9 | 0,11 |
| LG Chem Ltd. | 27 | 7 | 0,10 |
| POSCO | 257 | 36 | 0,47 |
| | | 52 | 0,68 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| KT Corp. | 4.606 | 55 | 0,71 |
| LG Uplus Corp. | 4.140 | 37 | 0,48 |
| SK Telecom Co. Ltd. | 1.661 | 33 | 0,44 |
| | | 125 | 1,63 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Korea Electric Power Corp. | 660 | 28 | 0,37 |
| Summe Südkorea | | 1.089 | 14,19 |
| **TAIWAN** | | | |
| Acer, Inc. | 21.000 | 8 | 0,10 |
| Advanced Semiconductor Engineering, Inc. | 3.000 | 3 | 0,05 |
| Asia Cement Corp. | 4.000 | 3 | 0,04 |
| Asustek Computer, Inc. | 3.000 | 25 | 0,32 |
| AU Optronics Corp. | 50.000 | 15 | 0,19 |
| China Development Financial Holding Corp. | 29.000 | 7 | 0,09 |
| China Life Insurance Co. Ltd. | 22.400 | 17 | 0,22 |
| China Steel Corp. | 18.000 | 10 | 0,13 |
| Chunghwa Telecom Co. Ltd. | 23.000 | 69 | 0,90 |
| Compal Electronics, Inc. | 51.000 | 29 | 0,37 |
| CTBC Financial Holding Co. Ltd. | 10.215 | 5 | 0,07 |
| Delta Electronics, Inc. | 1.000 | 5 | 0,06 |
| Far Eastern New Century Corp. | 15.300 | 12 | 0,16 |
| Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. | 6.000 | 12 | 0,16 |
| First Financial Holding Co. Ltd. | 8.520 | 4 | 0,05 |
| Formosa Chemicals & Fibre Corp. | 2.000 | 4 | 0,06 |
| Fubon Financial Holding Co. Ltd. | 2.000 | 3 | 0,04 |
| Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 19.050 | 47 | 0,61 |
| HTC Corp. | 6.000 | 14 | 0,19 |
| Innolux Corp. | 34.000 | 10 | 0,13 |
| Lite-On Technology Corp. | 19.095 | 18 | 0,24 |
| Mega Financial Holding Co. Ltd. | 18.380 | 12 | 0,15 |
| Pegatron Corp. | 6.000 | 13 | 0,17 |
| Pou Chen Corp. | 15.000 | 20 | 0,26 |
| Powertech Technology, Inc. | 7.000 | 14 | 0,18 |
| Quanta Computer, Inc. | 7.000 | 11 | 0,15 |
| Shin Kong Financial Holding Co. Ltd. | 17.694 | 4 | 0,05 |
| SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. | 11.809 | 3 | 0,04 |
| Synnex Technology International Corp. | 3.000 | 3 | 0,04 |
| Taishin Financial Holding Co. Ltd. | 16.000 | 6 | 0,07 |
| Taiwan Cement Corp. | 8.000 | 7 | 0,09 |
| Taiwan Mobile Co. Ltd. | 3.000 | 9 | 0,12 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 6.484 | 148 | 1,92 |
| Uni-President Enterprises Corp. | 8.320 | 14 | 0,18 |
| United Microelectronics Corp. | 69.000 | 25 | 0,33 |
| Wistron Corp. | 23.707 | 13 | 0,17 |
| WPG Holdings Ltd. | 4.000 | 4 | 0,05 |
| Yuanta Financial Holding Co. Ltd. | 9.236 | 3 | 0,04 |
| | | 629 | 8,19 |

## Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **THAILAND** | | | |
| Advanced Info Service PCL | 800 | $ 3 | 0,04 |
| Bangkok Bank PCL | 8.700 | 37 | 0,48 |
| Banpu PCL | 49.600 | 22 | 0,29 |
| Charoen Pokphand Foods PCL | 7.000 | 4 | 0,05 |
| Kasikornbank PCL | 4.100 | 17 | 0,22 |
| Krung Thai Bank PCL | 37.100 | 17 | 0,22 |
| PTT Exploration & Production PCL | 14.000 | 22 | 0,29 |
| PTT Global Chemical PCL | 7.100 | 10 | 0,12 |
| PTT PCL | 7.700 | 52 | 0,68 |
| Siam Cement PCL | 400 | 5 | 0,07 |
| Siam Commercial Bank PCL | 4.300 | 14 | 0,19 |
| Thai Oil PCL | 5.300 | 10 | 0,13 |
| | | 213 | 2,78 |
| Summe Stammaktien | | 6.810 | 88,74 |
| **AKTIENNAHE WERTPAPIERE** | | | |
| Aditya Birla Nuvo Ltd. Verf. 02.09.2019 | 210 | 7 | 0,09 |
| Axis Bank Ltd. Verf. 25.01.2018 | 1.300 | 9 | 0,11 |
| Bharat Heavy Electricals Ltd. Verf. 28.03.2016 | 2.200 | 6 | 0,07 |
| Bharat Petroleum Corp. Ltd. Verf. 13.12.2017 | 790 | 11 | 0,14 |
| Cairn India Ltd. Verf. 08.06.2017 | 1.750 | 4 | 0,05 |
| GAIL India Ltd. Verf. 25.01.2018 | 1.090 | 6 | 0,08 |
| Hero MotoCorp Ltd. Verf. 13.04.2017 | 230 | 9 | 0,12 |
| Hindalco Industries Ltd. Verf. 23.05.2018 | 2.230 | 3 | 0,04 |
| Hindustan Unilever Ltd. Verf. 13.04.2017 | 690 | $ 9 | 0,12 |
| HSBC Bank PLC Verf. 10.03.2016 | 6.490 | 14 | 0,18 |
| Verf. 30.06.2016 | 16.268 | 79 | 1,04 |
| Verf. 01.08.2016 | 620 | 3 | 0,04 |
| Verf. 22.09.2016 | 1.870 | 9 | 0,12 |
| Verf. 28.09.2016 | 90 | 4 | 0,06 |
| Verf. 05.12.2016 | 200 | 8 | 0,10 |
| ITC Ltd. Verf. 04.08.2016 | 3.900 | 19 | 0,25 |
| Jaiprakash Associates Ltd. Verf. 30.08.2018 | 48.370 | 9 | 0,11 |
| Jindal Steel & Power Ltd. Verf. 26.04.2017 | 3.510 | 5 | 0,07 |
| Mahindra & Mahindra Ltd. Verf. 07.03.2017 | 460 | 9 | 0,12 |
| Oil & Natural Gas Corp. Ltd. Verf. 08.06.2017 | 4.290 | 16 | 0,20 |
| Punjab National Bank Verf. 05.05.2016 | 4.764 | 8 | 0,11 |
| Reliance Communications Ltd. Verf. 26.06.2019 | 6.160 | 8 | 0,11 |
| Rumo Logistica Operadora Multimodal S.A. Verf. 01.02.2016 | 441 | 0 | 0,00 |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd. Verf. 03.04.2018 | 1.280 | 16 | 0,21 |
| Tata Consultancy Services Ltd. Verf. 07.03.2017 | 130 | 5 | 0,06 |
| Tata Power Co. Ltd. Verf. 05.04.2019 | 14.342 | 15 | 0,19 |
| Summe Aktiengebundene Wertpapiere | | 291 | 3,79 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| AES Tiete S.A. | 4.600 | 17 | 0,22 |
| AK Transneft OAO | 16 | 42 | 0,55 |
| Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A. | 3.400 | $ 5 | 0,07 |
| Bashneft PAO | 415 | 10 | 0,13 |
| Braskem S.A. | 2.000 | 14 | 0,18 |
| Centrais Eletricas Brasileiras S.A. | 19.400 | 51 | 0,66 |
| Compania Brasileira de Distribuicao | 1.500 | 16 | 0,21 |
| Compania Energetica de Sao Paulo | 4.700 | 16 | 0,21 |
| Compania Paranaense de Energia | 1.300 | 8 | 0,10 |
| Eletropaulo Metropolitana Eletricidade de Sao Paulo S.A. | 3.800 | 8 | 0,11 |
| Itau Unibanco Holding S.A. | 20.549 | 134 | 1,74 |
| Metalurgica Gerdau S.A. | 15.800 | 6 | 0,09 |
| Oi S.A. | 33.500 | 16 | 0,21 |
| Suzano Papel e Celulose S.A. | 1.000 | 5 | 0,06 |
| Usinas Siderurgicas de Minas Gerais S.A. | 7.300 | 3 | 0,04 |
| Vale S.A. | 66.300 | 170 | 2,21 |
| Summe Vorzugswertpapiere | | 521 | 6,79 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Growthpoint Properties Ltd. | 2.350 | 3 | 0,04 |
| Redefine Properties Ltd. | 6.014 | 4 | 0,05 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 7 | 0,09 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 7.629** | **99,41** |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Anlagen** | **$ 7.629** | **99,41** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | |
| **ANZ National Bank** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 1 | $ 1 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | 16 | 16 | 0,21 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 5 | 5 | 0,06 |
| **HSBC Bank** | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD 3 | 0 | 0,01 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR 12 | 1 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 5 | 5 | 0,06 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | **$ 28** | **0,36** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | **$ 17** | **0,23** |
| **Nettovermögen** | | **$ 7.674** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

**(a) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.545 | $ 6.078 | $ 6 | $ 7.629 |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

**(b) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,41 | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| China Construction Bank Corp. | 414.000 | $ 374 |
| Gazprom PAO | 64.400 | 309 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. | 393.000 | 309 |
| Bank of China Ltd. | 468.000 | 303 |
| Vale S.A. | 66.300 | 294 |
| China Mobile Ltd. | 22.000 | 282 |
| Lukoil PJSC | 6.110 | 263 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 237 | 254 |
| Itau Unibanco Holding S.A. | 19.904 | 214 |
| Surgutneftegas OAO | 36.460 | 213 |
| America Movil SAB de CV | 7.977 | 164 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 7.159 | 163 |
| MTN Group Ltd. | 8.670 | 147 |
| Standard Bank Group Ltd. | 10.410 | 136 |
| State Bank of India | 3.270 | 135 |
| Banco do Brasil S.A. | 17.200 | 134 |
| Banco Bradesco S.A. | 12.888 | 118 |
| MMC Norilsk Nickel OJSC | 6.910 | 116 |
| China Petroleum & Chemical Corp. | 138.000 | 114 |
| CNOOC Ltd. | 82.000 | 109 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| State Bank of India | 2.260 | $ 82 |
| SK Holdings Co. Ltd. | 150 | 35 |
| Petroleo Brasileiro S.A. | 5.700 | 33 |
| Reliance Industries Ltd. | 1.180 | 32 |
| Tata Motors Ltd. | 1.085 | 31 |
| China Mobile Ltd. | 2.500 | 29 |
| HTC Corp. | 10.000 | 23 |
| Korea Electric Power Corp. | 530 | 22 |
| Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT | 87.000 | 18 |
| Banco Bradesco S.A. | 3.296 | 18 |
| China Railway Group Ltd. | 18.000 | 15 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 675 | 15 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 18.500 | 14 |
| Bank of China Ltd. | 30.000 | 13 |
| China Railway Construction Corp. Ltd. | 9.500 | 13 |
| Chunghwa Telecom Co. Ltd. | 4.000 | 12 |
| PetroChina Co. Ltd. | 16.000 | 12 |
| Hellenic Telecommunications Organization S.A. | 1.240 | 12 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. | 320 | 11 |
| Steinhoff International Holdings Ltd. | 1.790 | 11 |
| Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 4.000 | 11 |
| X5 Retail Group NV | 520 | 10 |
| China Communications Construction Co. Ltd. | 8.000 | 9 |
| Itau Unibanco Holding S.A. | 1.197 | 9 |
| Fubon Financial Holding Co. Ltd. | 5.000 | 8 |
| Acer, Inc. | 22.000 | 8 |
| OPAP S.A. | 1.084 | 8 |
| AU Optronics Corp. | 30.000 | 8 |
| Siliconware Precision Industries Co. Ltd. | 6.000 | 8 |
| Pegatron Corp. | 3.000 | 8 |
| Sanlam Ltd. | 1.751 | 8 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

31. Dezember 2015

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | |
| BHP Billiton PLC | 8.644 | € 89 | 0,31 |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| Erste Group Bank AG | 2.765 | 80 | 0,28 |
| Oesterreichische Post AG | 215 | 7 | 0,03 |
| OMV AG | 3.640 | 95 | 0,33 |
| Raiffeisen Bank International AG | 1.567 | 21 | 0,07 |
| Verbund AG | 984 | 12 | 0,04 |
| voestalpine AG | 463 | 13 | 0,05 |
| | | 228 | 0,80 |
| **BELGIEN** | | | |
| Ageas | 2.275 | 97 | 0,34 |
| Anheuser-Busch InBev S.A. | 1.601 | 183 | 0,65 |
| Delhaize Group | 1.324 | 119 | 0,42 |
| Elia System Operator S.A. | 227 | 10 | 0,03 |
| KBC Groep NV | 476 | 27 | 0,10 |
| Mobistar S.A. | 829 | 19 | 0,06 |
| Proximus SADP | 1.513 | 45 | 0,16 |
| Solvay S.A. | 161 | 16 | 0,06 |
| Telenet Group Holding NV | 281 | 14 | 0,05 |
| UCB S.A. | 167 | 14 | 0,05 |
| Umicore S.A. | 553 | 21 | 0,07 |
| | | 565 | 1,99 |
| **CHILE** | | | |
| Antofagasta PLC | 1.160 | 7 | 0,03 |
| **DÄNEMARK** | | | |
| AP Moeller - Maersk | 88 | 106 | 0,37 |
| Carlsberg | 782 | 64 | 0,22 |
| Coloplast | 190 | 14 | 0,05 |
| Danske Bank | 679 | 17 | 0,06 |
| ISS | 2.303 | 76 | 0,27 |
| Novo Nordisk | 4.472 | 238 | 0,84 |
| Pandora | 220 | 25 | 0,09 |
| Sydbank | 635 | 19 | 0,07 |
| TDC | 14.636 | 67 | 0,24 |
| | | 626 | 2,21 |
| **FINNLAND** | | | |
| Amer Sports OYJ | 596 | 16 | 0,06 |
| Elisa OYJ | 330 | 11 | 0,04 |
| Fortum OYJ | 887 | 12 | 0,04 |
| Kesko OYJ | 675 | 22 | 0,08 |
| Kone OYJ | 546 | 21 | 0,07 |
| Konecranes OYJ | 320 | 7 | 0,03 |
| Neste OYJ | 1.110 | 31 | 0,11 |
| Sampo OYJ | 687 | 32 | 0,11 |
| Stora Enso OYJ | 4.800 | 40 | 0,14 |
| Tieto OYJ | 961 | 24 | 0,08 |
| Wartsila OYJ Abp | 327 | 14 | 0,05 |
| | | 230 | 0,81 |
| **FRANKREICH** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Accor S.A. | 539 | 21 | 0,08 |
| Christian Dior SE | 239 | 37 | 0,13 |
| Cie Generale des Etablissements Michelin | 916 | 80 | 0,28 |
| Eutelsat Communications S.A. | 496 | 14 | 0,05 |
| Hermes International | 43 | 13 | 0,05 |
| Kering | 253 | 40 | 0,14 |
| Lagardere S.C.A. | 1.474 | 40 | 0,14 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 851 | € 123 | 0,43 |
| Metropole Television S.A. | 742 | 12 | 0,04 |
| Publicis Groupe S.A. | 474 | 29 | 0,10 |
| Renault S.A. | 334 | 31 | 0,11 |
| SEB S.A. | 101 | 10 | 0,03 |
| Sodexo S.A. | 150 | 14 | 0,05 |
| Solocal Group | 1.882 | 13 | 0,05 |
| Valeo S.A. | 61 | 9 | 0,03 |
| Vivendi S.A. | 9.774 | 193 | 0,68 |
| | | 679 | 2,39 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 3.183 | 84 | 0,30 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 819 | 35 | 0,12 |
| Danone S.A. | 1.472 | 92 | 0,33 |
| L'Oreal S.A. | 698 | 108 | 0,38 |
| Pernod-Ricard S.A. | 515 | 54 | 0,19 |
| | | 373 | 1,32 |
| **ENERGY** | | | |
| Technip S.A. | 142 | 6 | 0,02 |
| Total S.A. | 13.747 | 567 | 2,00 |
| | | 573 | 2,02 |
| **FINANCIALS** | | | |
| AXA S.A. | 8.270 | 208 | 0,73 |
| BNP Paribas S.A. | 7.899 | 411 | 1,45 |
| CNP Assurances | 459 | 6 | 0,02 |
| Credit Agricole S.A. | 5.164 | 56 | 0,20 |
| Natixis S.A. | 1.752 | 9 | 0,03 |
| Nexity S.A. | 240 | 10 | 0,04 |
| SCOR SE | 735 | 25 | 0,09 |
| Societe Generale S.A. | 3.674 | 156 | 0,55 |
| Wendel S.A. | 160 | 17 | 0,06 |
| | | 898 | 3,17 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Essilor International S.A. | 533 | 61 | 0,22 |
| Sanofi | 4.028 | 316 | 1,11 |
| | | 377 | 1,33 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Air France-KLM | 12.337 | 86 | 0,30 |
| Airbus Group SE | 1.419 | 88 | 0,31 |
| Alstom S.A. | 888 | 25 | 0,09 |
| Bouygues S.A. | 1.966 | 72 | 0,25 |
| Cie de Saint-Gobain | 1.520 | 61 | 0,21 |
| Eiffage S.A. | 694 | 41 | 0,15 |
| Legrand S.A. | 262 | 14 | 0,05 |
| Rexel S.A. | 3.680 | 45 | 0,16 |
| Safran S.A. | 854 | 54 | 0,19 |
| Schneider Electric SE | 921 | 48 | 0,17 |
| Societe BIC S.A. | 90 | 14 | 0,05 |
| Teleperformance | 339 | 26 | 0,09 |
| Thales S.A. | 196 | 14 | 0,05 |
| Vinci S.A. | 2.207 | 130 | 0,46 |
| Zodiac Aerospace | 287 | 6 | 0,02 |
| | | 724 | 2,55 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Altran Technologies S.A. | 1.287 | 16 | 0,06 |
| Atos SE | 398 | 31 | 0,11 |
| Capital Gemini S.A. | 465 | 40 | 0,14 |
| Dassault Systemes | 347 | 25 | 0,09 |
| Neopost S.A. | 631 | 14 | 0,05 |
| UBISOFT Entertainment | 1.652 | 44 | 0,15 |
| | | 170 | 0,60 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Liquide S.A. | 965 | € 100 | 0,35 |
| Arkema S.A. | 193 | 12 | 0,05 |
| | | 112 | 0,40 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Orange S.A. | 30.091 | 463 | 1,63 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Electricite de France S.A. | 2.062 | 28 | 0,10 |
| Engie S.A. | 24.529 | 400 | 1,41 |
| Suez Environnement Co. | 2.526 | 43 | 0,15 |
| Veolia Environnement S.A. | 4.152 | 91 | 0,32 |
| | | 562 | 1,98 |
| Summe Frankreich | | 4.931 | 17,39 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| adidas AG | 783 | 70 | 0,25 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 921 | 89 | 0,31 |
| Continental AG | 121 | 27 | 0,09 |
| Daimler AG | 2.270 | 175 | 0,62 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 657 | 30 | 0,11 |
| | | 391 | 1,38 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| METRO AG | 4.074 | 119 | 0,42 |
| Suedzucker AG | 2.247 | 41 | 0,15 |
| | | 160 | 0,57 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Commerzbank AG | 9.513 | 90 | 0,32 |
| Deutsche Bank AG | 9.839 | 220 | 0,77 |
| Deutsche Börse AG | 489 | 39 | 0,14 |
| Hannover Rueck SE | 444 | 47 | 0,16 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 1.067 | 196 | 0,69 |
| Talanx AG | 459 | 13 | 0,05 |
| | | 605 | 2,13 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Bayer AG | 2.228 | 256 | 0,90 |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 777 | 60 | 0,21 |
| Fresenius SE & Co. KGaA | 1.191 | 78 | 0,28 |
| Merck KGaA | 503 | 45 | 0,16 |
| Rhoen Klinikum AG | 745 | 21 | 0,07 |
| STADA Arzneimittel AG | 239 | 9 | 0,03 |
| | | 469 | 1,65 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Bilfinger SE | 617 | 27 | 0,09 |
| Brenntag AG | 396 | 19 | 0,07 |
| Deutsche Lufthansa AG | 10.028 | 145 | 0,51 |
| Deutsche Post AG | 4.177 | 107 | 0,38 |
| Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide | 151 | 9 | 0,03 |
| GEA Group AG | 347 | 13 | 0,04 |
| HOCHTIEF AG | 550 | 47 | 0,17 |
| OSRAM Licht AG | 494 | 19 | 0,07 |
| Rheinmetall AG | 237 | 15 | 0,05 |
| Siemens AG | 970 | 86 | 0,30 |
| Sixt SE | 401 | 19 | 0,07 |
| | | 506 | 1,78 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| SAP SE | 2.121 | 155 | 0,55 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Aurubis AG | 251 | € 12 | 0,04 |
| BASF SE | 2.967 | 208 | 0,73 |
| Evonik Industries AG | 489 | 15 | 0,05 |
| HeidelbergCement AG | 563 | 42 | 0,15 |
| K+S AG | 1.466 | 34 | 0,12 |
| LANXESS AG | 362 | 15 | 0,05 |
| Salzgitter AG | 694 | 16 | 0,06 |
| Symrise AG | 359 | 22 | 0,08 |
| | | 364 | 1,28 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Deutsche Telekom AG | 20.325 | 336 | 1,18 |
| Freenet AG | 435 | 13 | 0,05 |
| | | 349 | 1,23 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| E.ON SE | 9.424 | 84 | 0,29 |
| RWE AG | 12.342 | 143 | 0,51 |
| | | 227 | 0,80 |
| Summe Deutschland | | 3.226 | 11,37 |
| **IRLAND** | | | |
| CRH PLC | 3.197 | 85 | 0,30 |
| Experian PLC | 2.826 | 46 | 0,16 |
| Kerry Group PLC | 460 | 35 | 0,12 |
| Medtronic PLC | 3.018 | 214 | 0,75 |
| Perrigo Co. PLC | 322 | 43 | 0,15 |
| Shire PLC | 1.418 | 90 | 0,32 |
| Smurfit Kappa Group PLC | 2.009 | 47 | 0,17 |
| | | 560 | 1,97 |
| **ITALIEN** | | | |
| Banca Popolare di Sondrio SCARL | 3.036 | 12 | 0,04 |
| Enel SpA | 57.738 | 223 | 0,79 |
| ENI SpA | 16.062 | 219 | 0,77 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 50.875 | 155 | 0,55 |
| Italcementi SpA | 1.845 | 19 | 0,07 |
| Luxottica Group SpA | 587 | 35 | 0,12 |
| Mediaset SpA | 4.908 | 19 | 0,07 |
| Prysmian SpA | 779 | 16 | 0,06 |
| Saipem SpA | 1.858 | 14 | 0,05 |
| Telecom Italia SpA | 157.760 | 184 | 0,65 |
| UniCredit SpA | 12.381 | 63 | 0,22 |
| Unione di Banche Italiane SpA | 4.184 | 26 | 0,09 |
| | | 985 | 3,48 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| ArcelorMittal | 6.325 | 24 | 0,09 |
| RTL Group S.A. | 164 | 13 | 0,04 |
| SES S.A. | 778 | 20 | 0,07 |
| | | 57 | 0,20 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| Aegon NV | 4.381 | 23 | 0,08 |
| Akzo Nobel NV | 1.073 | 66 | 0,23 |
| Fugro NV | 379 | 6 | 0,02 |
| Heineken Holding NV | 947 | 67 | 0,24 |
| Heineken NV | 656 | 51 | 0,18 |
| ING Groep NV | 26.600 | 331 | 1,17 |
| Koninklijke Ahold NV | 8.442 | 164 | 0,58 |
| Koninklijke BAM Groep NV | 2.928 | 15 | 0,05 |
| Koninklijke DSM NV | 522 | 24 | 0,09 |
| Koninklijke KPN NV | 14.449 | 50 | 0,18 |
| Koninklijke Philips NV | 3.584 | 84 | 0,30 |
| Koninklijke Vopak NV | 380 | 15 | 0,05 |
| NN Group NV | 866 | 28 | 0,10 |
| NXP Semiconductors NV | 215 | 17 | 0,06 |
| PostNL NV | 6.618 | € 23 | 0,08 |
| Randstad Holding NV | 154 | 9 | 0,03 |
| Royal Dutch Shell PLC | 39.211 | 823 | 2,90 |
| TNT Express NV | 2.952 | 23 | 0,08 |
| VimpelCom Ltd. | 7.660 | 23 | 0,08 |
| Wolters Kluwer NV | 1.314 | 41 | 0,14 |
| | | 1.883 | 6,64 |
| **NORWEGEN** | | | |
| DNB ASA | 2.890 | 33 | 0,12 |
| Fred Olsen Energy ASA | 2.595 | 9 | 0,03 |
| Gjensidige Forsikring ASA | 928 | 14 | 0,05 |
| Marine Harvest ASA | 640 | 8 | 0,03 |
| Orkla ASA | 3.120 | 23 | 0,08 |
| Petroleum Geo-Services ASA | 8.483 | 32 | 0,11 |
| Statoil ASA | 19.643 | 252 | 0,89 |
| Telenor ASA | 3.086 | 47 | 0,17 |
| TGS Nopec Geophysical Co. ASA | 840 | 12 | 0,04 |
| Yara International ASA | 1.013 | 40 | 0,14 |
| | | 470 | 1,66 |
| **PORTUGAL** | | | |
| CTT-Correios de Portugal S.A. | 975 | 9 | 0,03 |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 17.847 | 59 | 0,21 |
| | | 68 | 0,24 |
| **RUSSLAND** | | | |
| Evraz PLC | 7.322 | 7 | 0,03 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| Investec PLC | 2.845 | 18 | 0,06 |
| Mondi PLC | 1.986 | 36 | 0,13 |
| | | 54 | 0,19 |
| **SPANIEN** | | | |
| Acciona S.A. | 435 | 34 | 0,12 |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 490 | 13 | 0,05 |
| Amadeus IT Holding S.A. | 872 | 35 | 0,12 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 5.437 | 37 | 0,13 |
| Banco Santander S.A. | 86.809 | 393 | 1,38 |
| Endesa S.A. | 3.956 | 73 | 0,26 |
| Ferrovial S.A. | 2.563 | 53 | 0,19 |
| Fomento de Construcciones y Contratas S.A. | 2.457 | 17 | 0,06 |
| Iberdrola S.A. | 13.541 | 88 | 0,31 |
| Industria de Diseno Textil S.A. | 3.534 | 112 | 0,39 |
| Mapfre S.A. | 10.628 | 25 | 0,09 |
| Prosegur Compania de Seguridad S.A. | 1.774 | 8 | 0,03 |
| Repsol S.A. | 2.665 | 27 | 0,09 |
| Telefonica S.A. | 32.957 | 337 | 1,19 |
| | | 1.252 | 4,41 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| Assa Abloy AB | 2.149 | 41 | 0,15 |
| Atlas Copco AB | 2.584 | 58 | 0,21 |
| Autoliv, Inc. | 130 | 15 | 0,05 |
| Boliden AB | 854 | 13 | 0,05 |
| Electrolux AB | 1.764 | 39 | 0,14 |
| Getinge AB | 965 | 23 | 0,08 |
| Hennes & Mauritz AB | 2.006 | 66 | 0,23 |
| Holmen AB | 488 | 14 | 0,05 |
| Nordea Bank AB | 8.963 | 91 | 0,32 |
| Ratos AB | 2.365 | 13 | 0,04 |
| Sandvik AB | 3.362 | 27 | 0,09 |
| Securitas AB | 2.544 | 36 | 0,13 |
| Skanska AB | 702 | 13 | 0,04 |
| SKF AB | 1.177 | 17 | 0,06 |
| Svenska Cellulosa AB SCA | 1.791 | € 48 | 0,17 |
| Svenska Handelsbanken AB | 5.022 | 61 | 0,22 |
| Swedbank AB | 1.130 | 23 | 0,08 |
| Swedish Match AB | 1.036 | 34 | 0,12 |
| Tele2 AB | 10.733 | 99 | 0,35 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson | 11.870 | 105 | 0,37 |
| TeliaSonera AB | 17.262 | 79 | 0,28 |
| Volvo AB | 5.715 | 49 | 0,17 |
| | | 964 | 3,40 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 315 | 21 | 0,07 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Coca-Cola HBC AG | 672 | 13 | 0,05 |
| Nestle S.A. | 8.422 | 576 | 2,03 |
| | | 589 | 2,08 |
| **ENERGY** | | | |
| Transocean Ltd. | 4.471 | 51 | 0,18 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Baloise Holding AG | 230 | 27 | 0,10 |
| Credit Suisse Group AG | 8.094 | 161 | 0,57 |
| Helvetia Holding AG | 62 | 32 | 0,11 |
| Julius Baer Group Ltd. | 436 | 19 | 0,07 |
| Swiss Life Holding AG | 173 | 43 | 0,15 |
| Swiss Re AG | 2.760 | 248 | 0,88 |
| UBS Group AG | 11.496 | 205 | 0,72 |
| Zurich Insurance Group AG | 864 | 205 | 0,72 |
| | | 940 | 3,32 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Galenica AG | 10 | 14 | 0,05 |
| Lonza Group AG | 216 | 32 | 0,11 |
| Novartis AG | 7.447 | 590 | 2,08 |
| Roche Holding AG | 2.060 | 526 | 1,86 |
| Sonova Holding AG | 119 | 14 | 0,05 |
| | | 1.176 | 4,15 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 6.389 | 105 | 0,37 |
| Adecco S.A. | 362 | 23 | 0,08 |
| Gategroup Holding AG | 507 | 20 | 0,07 |
| Geberit AG | 29 | 9 | 0,03 |
| Georg Fischer AG | 15 | 9 | 0,03 |
| Kuehne + Nagel International AG | 243 | 31 | 0,11 |
| Schindler Holding AG | 429 | 66 | 0,23 |
| SGS S.A. | 6 | 11 | 0,04 |
| Sulzer AG | 139 | 12 | 0,04 |
| Wolseley PLC | 1.096 | 55 | 0,20 |
| | | 341 | 1,20 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| STMicroelectronics NV | 1.835 | 12 | 0,04 |
| TE Connectivity Ltd. | 1.064 | 63 | 0,22 |
| | | 75 | 0,26 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Clariant AG | 1.216 | 21 | 0,07 |
| Givaudan S.A. | 22 | 37 | 0,13 |
| LafargeHolcim Ltd. | 531 | 24 | 0,09 |
| Syngenta AG | 313 | 113 | 0,40 |
| | | 195 | 0,69 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Swisscom AG | 91 | 42 | 0,15 |
| Summe Schweiz | | 3.430 | 12,10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Barratt Developments PLC | 1.535 | € 13 | 0,05 |
| Berkeley Group Holdings PLC | 280 | 14 | 0,05 |
| Burberry Group PLC | 1.058 | 17 | 0,06 |
| Compass Group PLC | 5.668 | 90 | 0,32 |
| Enterprise Inns PLC | 5.284 | 8 | 0,03 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 5.340 | 68 | 0,24 |
| GKN PLC | 3.356 | 14 | 0,05 |
| Greene King PLC | 1.426 | 18 | 0,06 |
| Halfords Group PLC | 2.955 | 13 | 0,05 |
| Home Retail Group PLC | 19.253 | 26 | 0,09 |
| Inchcape PLC | 2.225 | 24 | 0,08 |
| Informa PLC | 1.673 | 14 | 0,05 |
| InterContinental Hotels Group PLC | 633 | 23 | 0,08 |
| ITV PLC | 10.661 | 40 | 0,14 |
| Kingfisher PLC | 14.772 | 66 | 0,23 |
| Ladbrokes PLC | 6.381 | 10 | 0,04 |
| Marks & Spencer Group PLC | 12.136 | 74 | 0,26 |
| Next PLC | 430 | 43 | 0,15 |
| Pearson PLC | 4.412 | 44 | 0,15 |
| RELX NV | 3.114 | 48 | 0,17 |
| RELX PLC | 3.497 | 57 | 0,20 |
| Sky PLC | 4.094 | 62 | 0,22 |
| Thomas Cook Group PLC | 22.428 | 37 | 0,13 |
| UBM PLC | 1.815 | 13 | 0,05 |
| WH Smith PLC | 1.018 | 24 | 0,09 |
| WPP PLC | 4.758 | 101 | 0,35 |
| | | 961 | 3,39 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Associated British Foods PLC | 668 | 30 | 0,11 |
| British American Tobacco PLC | 6.506 | 333 | 1,17 |
| Diageo PLC | 5.366 | 135 | 0,47 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 5.069 | 246 | 0,87 |
| J Sainsbury PLC | 18.195 | 64 | 0,22 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 1.895 | 161 | 0,57 |
| SABMiller PLC | 1.955 | 108 | 0,38 |
| Tate & Lyle PLC | 3.014 | 24 | 0,09 |
| Tesco PLC | 73.751 | 149 | 0,53 |
| Unilever NV | 4.958 | 199 | 0,70 |
| Unilever PLC | 2.600 | 103 | 0,36 |
| Wm Morrison Supermarkets PLC | 57.022 | 114 | 0,40 |
| | | 1.666 | 5,87 |
| **ENERGY** | | | |
| BG Group PLC | 9.618 | 128 | 0,45 |
| BP PLC | 98.871 | 473 | 1,67 |
| Cairn Energy PLC | 6.445 | 14 | 0,05 |
| Petrofac Ltd. | 1.273 | 14 | 0,05 |
| Premier Oil PLC | 12.761 | 8 | 0,03 |
| Tullow Oil PLC | 6.655 | 15 | 0,05 |
| | | 652 | 2,30 |
| **FINANCIALS** | | | |
| 3i Group PLC | 5.073 | 33 | 0,12 |
| Admiral Group PLC | 598 | 14 | 0,05 |
| Amlin PLC | 3.120 | € 28 | 0,10 |
| Aviva PLC | 10.415 | 73 | 0,26 |
| Barclays PLC | 109.645 | 325 | 1,15 |
| Beazley PLC | 2.881 | 15 | 0,05 |
| Close Brothers Group PLC | 620 | 11 | 0,04 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 8.757 | 48 | 0,17 |
| HSBC Holdings PLC | 120.457 | 875 | 3,09 |
| ICAP PLC | 6.986 | 48 | 0,17 |
| IG Group Holdings PLC | 1.512 | 17 | 0,06 |
| Intermediate Capital Group PLC | 2.780 | 24 | 0,08 |
| Lancashire Holdings Ltd. | 2.673 | 23 | 0,08 |
| Legal & General Group PLC | 13.323 | 48 | 0,17 |
| Lloyds Banking Group PLC | 230.419 | 228 | 0,80 |
| London Stock Exchange Group PLC | 277 | 10 | 0,04 |
| Man Group PLC | 29.115 | 69 | 0,24 |
| Prudential PLC | 2.075 | 43 | 0,15 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 19.549 | 80 | 0,28 |
| RSA Insurance Group PLC | 1.150 | 7 | 0,02 |
| Schroders PLC | 367 | 15 | 0,05 |
| Standard Chartered PLC | 24.269 | 185 | 0,65 |
| Standard Life PLC | 6.254 | 33 | 0,12 |
| Tullett Prebon PLC | 2.468 | 12 | 0,04 |
| | | 2.264 | 7,98 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AstraZeneca PLC | 6.059 | 377 | 1,33 |
| GlaxoSmithKline PLC | 15.919 | 296 | 1,04 |
| Smith & Nephew PLC | 1.860 | 30 | 0,11 |
| | | 703 | 2,48 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AA PLC | 4.034 | 17 | 0,06 |
| Aggreko PLC | 916 | 11 | 0,04 |
| Ashtead Group PLC | 960 | 14 | 0,05 |
| BAE Systems PLC | 23.029 | 156 | 0,55 |
| Berendsen PLC | 1.031 | 15 | 0,05 |
| Bunzl PLC | 362 | 9 | 0,03 |
| Capita PLC | 705 | 12 | 0,04 |
| Carillion PLC | 1.818 | 7 | 0,03 |
| CNH Industrial NV | 5.238 | 33 | 0,12 |
| easyJet PLC | 762 | 18 | 0,06 |
| Firstgroup PLC | 18.957 | 28 | 0,10 |
| G4S PLC | 6.435 | 20 | 0,07 |
| Go-Ahead Group PLC | 620 | 22 | 0,08 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | 9.287 | 77 | 0,27 |
| Meggitt PLC | 1.944 | 10 | 0,04 |
| National Express Group PLC | 2.123 | 10 | 0,03 |
| QinetiQ Group PLC | 3.422 | 13 | 0,04 |
| Rentokil Initial PLC | 9.328 | 20 | 0,07 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 505.886 | 43 | 0,15 |
| Royal Mail PLC | 9.773 | 59 | 0,21 |
| Serco Group PLC | 9.250 | 12 | 0,04 |
| Smiths Group PLC | 561 | 7 | 0,03 |
| | | 613 | 2,16 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| ARM Holdings PLC | 3.164 | € 44 | 0,16 |
| Electrocomponents PLC | 4.368 | 14 | 0,05 |
| Sage Group PLC | 7.301 | 60 | 0,21 |
| | | 118 | 0,42 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anglo American PLC | 20.614 | 84 | 0,29 |
| Croda International PLC | 319 | 13 | 0,05 |
| Johnson Matthey PLC | 225 | 8 | 0,03 |
| Rio Tinto PLC | 6.761 | 181 | 0,64 |
| | | 286 | 1,01 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BT Group PLC | 24.264 | 155 | 0,55 |
| Cable & Wireless Communications PLC | 21.914 | 22 | 0,08 |
| Inmarsat PLC | 1.694 | 26 | 0,09 |
| TalkTalk Telecom Group PLC | 4.434 | 13 | 0,05 |
| Vodafone Group PLC | 54.436 | 163 | 0,57 |
| | | 379 | 1,34 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Centrica PLC | 41.806 | 123 | 0,43 |
| National Grid PLC | 14.728 | 187 | 0,66 |
| Severn Trent PLC | 869 | 26 | 0,09 |
| SSE PLC | 3.007 | 62 | 0,22 |
| United Utilities Group PLC | 1.586 | 20 | 0,07 |
| | | 418 | 1,47 |
| Summe Großbritannien | | 8.060 | 28,42 |
| **USA** | | | |
| Carnival PLC | 1.078 | 57 | 0,20 |
| Summe Stammaktien | | 27.749 | 97,85 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Fuchs Petrolub SE | 218 | 9 | 0,03 |
| Henkel AG & Co. KGaA | 611 | 63 | 0,22 |
| Volkswagen AG | 807 | 107 | 0,38 |
| Summe Vorzugswertpapiere | | 179 | 0,63 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Fonciere Des Regions | 176 | 15 | 0,05 |
| Hammerson PLC | 2.971 | 24 | 0,09 |
| Intu Properties PLC | 2.179 | 9 | 0,03 |
| Land Securities Group PLC | 3.097 | 50 | 0,17 |
| Segro PLC | 3.627 | 21 | 0,08 |
| Unibail-Rodamco SE | 299 | 70 | 0,25 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 189 | 0,67 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 28.117** | **99,15** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund (Forts.)

| | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|
| **Summe Anlagen** | **€ 28.117** | **99,15** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 6 | € 8 | 0,03 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,01 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 5 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 6 | 1 | 0,00 |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 1 | 0 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 5 | 0 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 209 | 209 | 0,74 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,01 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **€ 224** | **0,79** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **€ 17** | **0,06** |
| **Nettovermögen** | | | **€ 28.358** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

**(a) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 1.041 | € 27.076 | € 0 | € 28.117 |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

**(b) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,15 | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| Royal Dutch Shell PLC | 51.342 | € 1.324 |
| HSBC Holdings PLC | 158.338 | 1.277 |
| Novartis AG | 10.571 | 971 |
| Nestle S.A. | 12.100 | 812 |
| Total S.A. | 17.781 | 794 |
| Roche Holding AG | 2.867 | 734 |
| Banco Santander S.A. | 111.127 | 704 |
| BP PLC | 126.404 | 691 |
| BNP Paribas S.A. | 11.267 | 651 |
| Orange S.A. | 43.547 | 641 |
| Telefonica S.A. | 46.509 | 631 |
| Barclays PLC | 152.297 | 587 |
| ING Groep NV | 39.183 | 581 |
| Engie S.A. | 32.661 | 562 |
| Astrazeneca PLC | 8.592 | 512 |
| Sanofi | 5.239 | 505 |
| Deutsche Telekom AG | 29.250 | 483 |
| British American Tobacco PLC | 8.521 | 438 |
| GlaxoSmithKleine PLC | 21.706 | 427 |
| Bayer AG | 3.230 | 423 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| Royal Dutch Shell PLC | 12.131 | € 276 |
| HSBC Holdings PLC | 37.881 | 266 |
| Novartis AG | 3.124 | 261 |
| Nestle S.A. | 3.678 | 246 |
| Orange S.A. | 13.456 | 201 |
| Roche Holding AG | 807 | 194 |
| BNP Paribas S.A. | 3.368 | 185 |
| Total S.A. | 4.034 | 168 |
| Old Mutual PLC | 61.680 | 166 |
| ING Groep NV | 12.583 | 165 |
| Telefonica S.A. | 13.552 | 154 |
| Astrazeneca PLC | 2.533 | 151 |
| Barclays PLC | 42.652 | 145 |
| Deutsche Telekom AG | 8.925 | 144 |
| BP PLC | 27.533 | 134 |
| Banco Santander S.A. | 24.318 | 127 |
| Engie S.A. | 8.132 | 126 |
| Bayer AG | 1.002 | 119 |
| Medtronic PLC | 1.692 | 111 |
| Sanofi | 1.211 | 106 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT | | | |
| STAMMAKTIEN | | | |
| AUSTRALIEN | | | |
| AMP Ltd. | 2.659 | $ 11 | 0,12 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | 1.104 | 22 | 0,23 |
| BHP Billiton Ltd. | 1.943 | 25 | 0,26 |
| Commonwealth Bank of Australia | 524 | 32 | 0,34 |
| National Australia Bank Ltd. | 846 | 18 | 0,19 |
| Orica Ltd. | 889 | 10 | 0,11 |
| QBE Insurance Group Ltd. | 948 | 9 | 0,09 |
| Santos Ltd. | 1.661 | 4 | 0,05 |
| Suncorp Group Ltd. | 1.869 | 16 | 0,17 |
| Telstra Corp. Ltd. | 2.658 | 11 | 0,11 |
| Wesfarmers Ltd. | 380 | 12 | 0,12 |
| Westpac Banking Corp. | 1.160 | 28 | 0,29 |
| Woolworths Ltd. | 477 | 9 | 0,09 |
| | | 207 | 2,17 |
| ÖSTERREICH | | | |
| Erste Group Bank AG | 337 | 10 | 0,11 |
| OMV AG | 407 | 12 | 0,12 |
| Raiffeisen Bank International AG | 634 | 9 | 0,10 |
| | | 31 | 0,33 |
| BELGIEN | | | |
| Delhaize Group | 149 | 14 | 0,15 |
| KBC Groep NV | 144 | 9 | 0,10 |
| Proximus SADP | 272 | 9 | 0,09 |
| | | 32 | 0,34 |
| KANADA | | | |
| Agrium, Inc. | 96 | 8 | 0,09 |
| Air Canada | 898 | 7 | 0,07 |
| Bank of Montreal | 360 | 20 | 0,21 |
| Bank of Nova Scotia | 421 | 17 | 0,18 |
| Barrick Gold Corp. | 1.078 | 8 | 0,08 |
| BCE, Inc. | 228 | 9 | 0,09 |
| BlackBerry Ltd. | 1.365 | 13 | 0,13 |
| Bombardier, Inc. | 5.137 | 5 | 0,05 |
| Brookfield Asset Management, Inc. | 274 | 9 | 0,09 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce (a) | 226 | 15 | 0,16 |
| Canadian National Railway Co. | 170 | 9 | 0,10 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 407 | 9 | 0,09 |
| Canadian Oil Sands Ltd. | 1.934 | 11 | 0,12 |
| Cenovus Energy, Inc. | 1.021 | 13 | 0,14 |
| Crescent Point Energy Corp. | 746 | 9 | 0,09 |
| Domtar Corp. | 243 | 9 | 0,09 |
| Goldcorp, Inc. | 763 | 9 | 0,09 |
| Husky Energy, Inc. | 517 | 5 | 0,06 |
| Kinross Gold Corp. | 4.311 | 8 | 0,08 |
| Manulife Financial Corp. | 990 | 15 | 0,16 |
| National Bank of Canada | 257 | 7 | 0,08 |
| Onex Corp. | 179 | 11 | 0,11 |
| Penn West Petroleum Ltd. | 5.680 | 5 | 0,05 |
| Power Corporation of Canada | 375 | 8 | 0,08 |
| Rogers Communications, Inc. | 395 | 13 | 0,14 |
| Royal Bank of Canada | 362 | 19 | 0,20 |
| Suncor Energy, Inc. | 1.581 | 41 | 0,43 |
| Teck Resources Ltd. | 1.388 | 5 | 0,06 |
| Toronto-Dominion Bank | 646 | 25 | 0,26 |
| TransCanada Corp. | 238 | 8 | 0,08 |
| Yamana Gold, Inc. | 3.289 | 6 | 0,06 |
| | | 356 | 3,72 |
| CHILE | | | |
| Antofagasta PLC | 923 | $ 6 | 0,07 |
| DÄNEMARK | | | |
| AP Moeller - Maersk | 7 | 9 | 0,10 |
| ISS | 303 | 11 | 0,11 |
| Novo Nordisk | 180 | 11 | 0,11 |
| TDC | 1.448 | 7 | 0,07 |
| | | 38 | 0,39 |
| FINNLAND | | | |
| Stora Enso OYJ | 927 | 8 | 0,09 |
| FRANKREICH | | | |
| Air France-KLM | 1.384 | 10 | 0,11 |
| AXA S.A. | 1.141 | 31 | 0,32 |
| BNP Paribas S.A. | 659 | 37 | 0,39 |
| Bouygues S.A. | 258 | 10 | 0,11 |
| Carrefour S.A. | 297 | 9 | 0,09 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 214 | 10 | 0,10 |
| Cie de Saint-Gobain | 439 | 19 | 0,20 |
| Cie Generale des Etablissements Michelin | 91 | 9 | 0,09 |
| Credit Agricole S.A. | 635 | 7 | 0,08 |
| Eiffage S.A. | 157 | 10 | 0,11 |
| Electricite de France S.A. | 429 | 6 | 0,07 |
| Engie S.A. | 2.480 | 44 | 0,46 |
| Orange S.A. | 4.162 | 70 | 0,73 |
| Renault S.A. | 91 | 9 | 0,09 |
| Rexel S.A. | 886 | 12 | 0,12 |
| Sanofi | 172 | 15 | 0,15 |
| Total S.A. | 1.758 | 79 | 0,82 |
| Veolia Environnement S.A. | 468 | 11 | 0,12 |
| Vinci S.A. | 332 | 21 | 0,22 |
| Vivendi S.A. | 1.018 | 22 | 0,23 |
| | | 441 | 4,61 |
| DEUTSCHLAND | | | |
| BASF SE | 205 | 16 | 0,16 |
| Bayer AG | 68 | 8 | 0,09 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 183 | 19 | 0,20 |
| Commerzbank AG | 1.196 | 12 | 0,13 |
| Daimler AG | 248 | 21 | 0,22 |
| Deutsche Bank AG | 1.200 | 29 | 0,31 |
| Deutsche Lufthansa AG | 1.595 | 25 | 0,26 |
| Deutsche Post AG | 446 | 12 | 0,13 |
| Deutsche Telekom AG | 2.423 | 44 | 0,46 |
| E.ON SE | 1.445 | 14 | 0,15 |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 32 | 3 | 0,03 |
| Fresenius SE & Co. KGaA | 152 | 11 | 0,11 |
| HeidelbergCement AG | 120 | 10 | 0,10 |
| K+S AG | 238 | 6 | 0,06 |
| METRO AG | 545 | 17 | 0,18 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 111 | 22 | 0,23 |
| RWE AG | 2.441 | 31 | 0,32 |
| Siemens AG | 216 | 21 | 0,22 |
| | | 321 | 3,36 |
| HONGKONG | | | |
| Hongkong Land Holdings Ltd. | 1.200 | 9 | 0,09 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd. | 1.000 | 12 | 0,12 |
| Swire Pacific Ltd. | 1.000 | 11 | 0,12 |
| | | 32 | 0,33 |
| IRLAND | | | |
| Accenture PLC | 164 | 17 | 0,18 |
| CRH PLC | 361 | 11 | 0,11 |
| Medtronic PLC | 232 | $ 18 | 0,18 |
| Shire PLC | 121 | 8 | 0,09 |
| | | 54 | 0,56 |
| ISRAEL | | | |
| Bank Leumi Le-Israel BM | 2.311 | 8 | 0,08 |
| Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd. | 5.640 | 13 | 0,13 |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd. | 250 | 16 | 0,17 |
| | | 37 | 0,38 |
| ITALIEN | | | |
| Assicurazioni Generali SpA | 524 | 9 | 0,10 |
| Enel SpA | 2.748 | 11 | 0,12 |
| ENI SpA | 2.197 | 33 | 0,34 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 6.830 | 23 | 0,24 |
| Telecom Italia SpA | 19.423 | 25 | 0,26 |
| UniCredit SpA | 1.390 | 8 | 0,08 |
| | | 109 | 1,14 |
| JAPAN | | | |
| Aeon Co. Ltd. | 700 | 11 | 0,11 |
| ANA Holdings, Inc. | 3.000 | 9 | 0,09 |
| Asahi Glass Co. Ltd. | 2.000 | 11 | 0,12 |
| Asahi Kasei Corp. | 1.000 | 7 | 0,07 |
| Canon, Inc. | 600 | 18 | 0,19 |
| Chubu Electric Power Co., Inc. | 700 | 10 | 0,10 |
| Dai-ichi Life Insurance Co. Ltd. | 900 | 15 | 0,16 |
| Daiichi Sankyo Co. Ltd. | 500 | 10 | 0,11 |
| East Japan Railway Co. | 100 | 9 | 0,10 |
| Eisai Co. Ltd. | 100 | 7 | 0,07 |
| Electric Power Development Co. Ltd. | 100 | 4 | 0,04 |
| FUJIFILM Holdings Corp. | 400 | 17 | 0,17 |
| Fujitsu Ltd. | 2.000 | 10 | 0,10 |
| Fukuoka Financial Group, Inc. | 2.000 | 10 | 0,10 |
| Hitachi Ltd. | 2.000 | 11 | 0,12 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 600 | 19 | 0,20 |
| Inpex Corp. | 900 | 9 | 0,09 |
| ITOCHU Corp. | 700 | 8 | 0,09 |
| Japan Airlines Co. Ltd. | 300 | 11 | 0,11 |
| JX Holdings, Inc. | 2.300 | 10 | 0,10 |
| Kansai Electric Power Co., Inc. | 900 | 11 | 0,11 |
| Kao Corp. | 200 | 10 | 0,11 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 700 | 9 | 0,10 |
| Kobe Steel Ltd. | 6.000 | 7 | 0,07 |
| Konica Minolta, Inc. | 900 | 9 | 0,09 |
| MEIJI Holdings Co. Ltd. | 200 | 17 | 0,17 |
| Mitsubishi Chemical Holdings Corp. | 2.700 | 17 | 0,18 |
| Mitsubishi Corp. | 900 | 15 | 0,16 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 7.700 | 48 | 0,50 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 1.600 | 19 | 0,20 |
| Mizuho Financial Group, Inc. | 18.800 | 38 | 0,39 |
| NEC Corp. | 3.000 | 9 | 0,10 |
| Nikon Corp. | 900 | 12 | 0,13 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 1.400 | 56 | 0,58 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | 1.200 | 13 | 0,13 |
| Nitto Denko Corp. | 100 | 7 | 0,08 |
| NTT DOCOMO, Inc. | 1.000 | 20 | 0,21 |
| Panasonic Corp. | 700 | 7 | 0,07 |
| Resona Holdings, Inc. | 1.800 | 9 | 0,09 |
| Ricoh Co. Ltd. | 1.300 | 13 | 0,14 |
| Sojitz Corp. | 4.000 | 8 | 0,09 |
| Sony Corp. | 700 | 17 | 0,18 |
| Sumitomo Chemical Co. Ltd. | 3.000 | 17 | 0,18 |
| Sumitomo Corp. | 900 | 9 | 0,10 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 800 | 30 | 0,31 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 300 | $ 15 | 0,16 |
| TDK Corp. | 100 | 6 | 0,07 |
| Tohoku Electric Power Co., Inc. | 700 | 9 | 0,09 |
| Toshiba Corp. | 4.000 | 8 | 0,09 |
| Toyota Motor Corp. | 200 | 12 | 0,13 |
| West Japan Railway Co. | 100 | 7 | 0,07 |
| | | 700 | 7,32 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| ArcelorMittal | 966 | 4 | 0,04 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| Aegon NV | 1.316 | 7 | 0,08 |
| Heineken Holding NV | 138 | 11 | 0,11 |
| ING Groep NV | 2.699 | 37 | 0,38 |
| Koninklijke Ahold NV | 909 | 19 | 0,20 |
| Koninklijke KPN NV | 2.967 | 11 | 0,12 |
| Koninklijke Philips NV | 385 | 10 | 0,10 |
| Royal Dutch Shell PLC | 4.903 | 112 | 1,17 |
| | | 207 | 2,16 |
| **NEUSEELAND** | | | |
| Spark New Zealand Ltd. | 5.234 | 12 | 0,12 |
| **NORWEGEN** | | | |
| DNB ASA | 848 | 10 | 0,11 |
| Statoil ASA | 2.706 | 38 | 0,39 |
| | | 48 | 0,50 |
| **PORTUGAL** | | | |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 2.529 | 9 | 0,09 |
| **SINGAPUR** | | | |
| DBS Group Holdings Ltd. | 700 | 8 | 0,09 |
| Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. | 1.400 | 9 | 0,09 |
| | | 17 | 0,18 |
| **SPANIEN** | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 1.266 | 9 | 0,10 |
| Banco Santander S.A. | 6.889 | 34 | 0,35 |
| Endesa S.A. | 505 | 10 | 0,11 |
| Ferrovial S.A. | 442 | 10 | 0,11 |
| Iberdrola S.A. | 1.911 | 14 | 0,14 |
| Mapfre S.A. | 2.792 | 7 | 0,07 |
| Telefonica S.A. | 3.456 | 38 | 0,40 |
| | | 122 | 1,28 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| Nordea Bank AB | 818 | 9 | 0,10 |
| Sandvik AB | 1.028 | 9 | 0,09 |
| Tele2 AB | 1.162 | 12 | 0,12 |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson | 918 | 9 | 0,09 |
| TeliaSonera AB | 1.905 | 9 | 0,10 |
| | | 48 | 0,50 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| ACE Ltd. | 96 | 11 | 0,12 |
| Credit Suisse Group AG | 825 | 18 | 0,19 |
| Novartis AG | 224 | 19 | 0,20 |
| Swiss Re AG | 266 | 26 | 0,27 |
| Transocean Ltd. | 761 | 10 | 0,10 |
| Weatherford International PLC | 800 | 7 | 0,07 |
| Zurich Insurance Group AG | 67 | 17 | 0,18 |
| | | 108 | 1,13 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| Anglo American PLC | 2.496 | 11 | 0,12 |
| AstraZeneca PLC | 530 | 36 | 0,37 |
| BAE Systems PLC | 3.627 | 27 | 0,28 |
| Barclays PLC | 11.374 | 37 | 0,38 |
| BP PLC | 15.394 | $ 80 | 0,84 |
| British American Tobacco PLC | 179 | 10 | 0,10 |
| Centrica PLC | 3.693 | 12 | 0,12 |
| CNH Industrial NV | 1.069 | 7 | 0,08 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 1.630 | 10 | 0,10 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 716 | 10 | 0,10 |
| GlaxoSmithKline PLC | 1.063 | 21 | 0,23 |
| HSBC Holdings PLC | 10.044 | 79 | 0,83 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 199 | 10 | 0,11 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | 1.235 | 11 | 0,12 |
| J Sainsbury PLC | 2.300 | 9 | 0,09 |
| Lloyds Banking Group PLC | 30.755 | 33 | 0,35 |
| Man Group PLC | 3.854 | 10 | 0,10 |
| Marks & Spencer Group PLC | 1.134 | 7 | 0,08 |
| National Grid PLC | 749 | 10 | 0,11 |
| Rio Tinto Ltd. | 242 | 8 | 0,08 |
| Rio Tinto PLC | 484 | 14 | 0,15 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 1.731 | 8 | 0,08 |
| Royal Mail PLC | 1.210 | 8 | 0,08 |
| SSE PLC | 400 | 9 | 0,09 |
| Standard Chartered PLC | 603 | 5 | 0,05 |
| Tesco PLC | 4.150 | 9 | 0,10 |
| Vodafone Group PLC | 11.572 | 37 | 0,39 |
| Wm Morrison Supermarkets PLC | 5.763 | 13 | 0,13 |
| WPP PLC | 431 | 10 | 0,10 |
| | | 551 | 5,76 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Amazon.com, Inc. | 53 | 36 | 0,37 |
| Apollo Education Group, Inc. | 612 | 5 | 0,05 |
| AutoZone, Inc. | 15 | 11 | 0,12 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 271 | 13 | 0,14 |
| Best Buy Co., Inc. | 873 | 27 | 0,28 |
| Cablevision Systems Corp. | 397 | 13 | 0,13 |
| Carnival Corp. | 401 | 22 | 0,23 |
| CBS Corp. | 175 | 8 | 0,09 |
| Coach, Inc. | 451 | 15 | 0,15 |
| Comcast Corp. | 813 | 46 | 0,48 |
| Dollar General Corp. | 126 | 9 | 0,09 |
| Dollar Tree, Inc. | 123 | 9 | 0,10 |
| Ford Motor Co. | 1.933 | 27 | 0,29 |
| GameStop Corp. | 339 | 9 | 0,10 |
| Gap, Inc. | 477 | 12 | 0,12 |
| General Motors Co. | 291 | 10 | 0,10 |
| Hasbro, Inc. | 129 | 9 | 0,09 |
| Home Depot, Inc. | 585 | 77 | 0,81 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 519 | 12 | 0,13 |
| Kohl's Corp. | 552 | 26 | 0,28 |
| L Brands, Inc. | 169 | 16 | 0,17 |
| Liberty Interactive Corporation QVC Group | 348 | 9 | 0,10 |
| Lowe's Cos., Inc. | 737 | 56 | 0,59 |
| Macy's, Inc. | 219 | 8 | 0,08 |
| Mattel, Inc. | 372 | 10 | 0,11 |
| McDonald's Corp. | 238 | 28 | 0,29 |
| NIKE, Inc. | 504 | 31 | 0,33 |
| Nordstrom, Inc. | 131 | 7 | 0,07 |
| Omnicom Group, Inc. | 189 | 14 | 0,15 |
| O'Reilly Automotive, Inc. | 43 | 11 | 0,11 |
| Ross Stores, Inc. | 199 | 11 | 0,11 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | 126 | 13 | 0,13 |
| Staples, Inc. | 1.661 | 16 | 0,16 |
| Target Corp. | 625 | 45 | 0,47 |
| Thomson Reuters Corp. | 257 | 10 | 0,10 |
| Time Warner Cable, Inc. | 266 | 49 | 0,52 |
| Time Warner, Inc. | 752 | 49 | 0,51 |
| Time, Inc. | 416 | $ 7 | 0,07 |
| TJX Cos., Inc. | 143 | 10 | 0,11 |
| Viacom, Inc. | 353 | 15 | 0,15 |
| Walt Disney Co. | 366 | 38 | 0,40 |
| Whirlpool Corp. | 56 | 8 | 0,09 |
| Wyndham Worldwide Corp. | 120 | 9 | 0,09 |
| Wynn Resorts Ltd. | 103 | 7 | 0,07 |
| Yum! Brands, Inc. | 108 | 8 | 0,08 |
| | | 881 | 9,21 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 441 | 26 | 0,27 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 202 | 7 | 0,08 |
| Avon Products, Inc. | 2.056 | 8 | 0,09 |
| Coca-Cola Co. | 601 | 26 | 0,27 |
| Coca-Cola Enterprises, Inc. | 222 | 11 | 0,11 |
| Colgate-Palmolive Co. | 151 | 10 | 0,11 |
| ConAgra Foods, Inc. | 258 | 11 | 0,11 |
| Costco Wholesale Corp. | 72 | 12 | 0,12 |
| CVS Health Corp. | 501 | 49 | 0,51 |
| Dr. Pepper Snapple Group, Inc. | 134 | 13 | 0,13 |
| General Mills, Inc. | 176 | 10 | 0,11 |
| Kraft Heinz Co. | 131 | 10 | 0,10 |
| Kroger Co. | 768 | 32 | 0,34 |
| Mondelez International, Inc. | 405 | 18 | 0,19 |
| PepsiCo, Inc. | 322 | 32 | 0,34 |
| Philip Morris International, Inc. | 565 | 50 | 0,52 |
| Procter & Gamble Co. | 837 | 66 | 0,69 |
| Reynolds American, Inc. | 262 | 12 | 0,13 |
| Rite Aid Corp. | 1.305 | 10 | 0,11 |
| SUPERVALU, Inc. | 1.182 | 8 | 0,08 |
| Sysco Corp. | 260 | 11 | 0,11 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 116 | 10 | 0,10 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 1.100 | 67 | 0,70 |
| | | 509 | 5,32 |
| **ENERGY** | | | |
| Apache Corp. | 479 | 21 | 0,22 |
| Baker Hughes, Inc. | 190 | 9 | 0,09 |
| California Resources Corp. | 2.623 | 6 | 0,07 |
| Cameron International Corp. | 220 | 14 | 0,15 |
| Chesapeake Energy Corp. | 2.996 | 13 | 0,14 |
| Chevron Corp. | 1.101 | 99 | 1,04 |
| ConocoPhillips | 1.310 | 61 | 0,64 |
| Denbury Resources, Inc. | 1.541 | 3 | 0,03 |
| Devon Energy Corp. | 165 | 5 | 0,06 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. | 372 | 8 | 0,08 |
| EOG Resources, Inc. | 157 | 11 | 0,12 |
| Exxon Mobil Corp. | 1.968 | 153 | 1,60 |
| Hess Corp. | 342 | 17 | 0,17 |
| HollyFrontier Corp. | 239 | 10 | 0,10 |
| Marathon Oil Corp. | 1.834 | 23 | 0,24 |
| Marathon Petroleum Corp. | 329 | 17 | 0,18 |
| Murphy Oil Corp. | 345 | 8 | 0,08 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 202 | 7 | 0,07 |
| Occidental Petroleum Corp. | 226 | 15 | 0,16 |
| Peabody Energy Corp. | 291 | 2 | 0,02 |
| Phillips 66 | 130 | 11 | 0,11 |
| Schlumberger Ltd. | 179 | 13 | 0,13 |
| Tesoro Corp. | 117 | 12 | 0,13 |
| Valero Energy Corp. | 165 | 12 | 0,12 |
| | | 550 | 5,75 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Aflac, Inc. | 157 | 9 | 0,10 |
| Allstate Corp. | 192 | 12 | 0,12 |
| American Express Co. | 253 | 18 | 0,18 |
| American Financial Group, Inc. | 96 | 7 | 0,07 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| American International Group, Inc. | 1.153 | $ 71 | 0,75 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 115 | 12 | 0,13 |
| Assurant, Inc. | 146 | 12 | 0,12 |
| BB&T Corp. | 533 | 20 | 0,21 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 452 | 60 | 0,62 |
| Capital One Financial Corp. | 504 | 36 | 0,38 |
| Chubb Corp. | 197 | 26 | 0,27 |
| CIT Group, Inc. | 212 | 8 | 0,09 |
| Citigroup, Inc. | 2.004 | 104 | 1,08 |
| Citizens Financial Group, Inc. | 385 | 10 | 0,11 |
| CME Group, Inc. | 155 | 14 | 0,15 |
| Discover Financial Services | 247 | 13 | 0,14 |
| E*TRADE Financial Corp. | 326 | 10 | 0,10 |
| Fifth Third Bancorp | 843 | 17 | 0,18 |
| Genworth Financial, Inc. | 3.592 | 13 | 0,14 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. | 338 | 15 | 0,15 |
| Huntington Bancshares, Inc. | 873 | 10 | 0,10 |
| JPMorgan Chase & Co. | 2.499 | 165 | 1,73 |
| KeyCorp | 651 | 9 | 0,09 |
| Legg Mason, Inc. | 190 | 7 | 0,08 |
| Lincoln National Corp. | 202 | 10 | 0,11 |
| Loews Corp. | 257 | 10 | 0,10 |
| M&T Bank Corp. | 78 | 9 | 0,10 |
| McGraw Hill Financial, Inc. | 167 | 16 | 0,17 |
| MetLife, Inc. | 347 | 17 | 0,18 |
| Morgan Stanley | 528 | 17 | 0,18 |
| Nasdaq, Inc. | 201 | 12 | 0,12 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 560 | 9 | 0,10 |
| Northern Trust Corp. | 183 | 13 | 0,14 |
| People's United Financial, Inc. | 602 | 10 | 0,10 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 352 | 34 | 0,35 |
| Progressive Corp. | 353 | 11 | 0,12 |
| Prudential Financial, Inc. | 110 | 9 | 0,09 |
| Regions Financial Corp. | 1.144 | 11 | 0,12 |
| Reinsurance Group of America, Inc. | 103 | 9 | 0,09 |
| SLM Corp. | 1.362 | 9 | 0,09 |
| SunTrust Banks, Inc. | 354 | 15 | 0,16 |
| Travelers Cos., Inc. | 512 | 58 | 0,60 |
| Unum Group | 272 | 9 | 0,09 |
| US Bancorp | 623 | 27 | 0,28 |
| Voya Financial, Inc. | 551 | 20 | 0,21 |
| Wells Fargo & Co. | 1.652 | 90 | 0,94 |
| | | 1.103 | 11,53 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 200 | 9 | 0,09 |
| AbbVie, Inc. | 369 | 22 | 0,23 |
| Aetna, Inc. | 235 | 25 | 0,27 |
| Amgen, Inc. | 215 | 35 | 0,36 |
| Anthem, Inc. | 370 | 52 | 0,54 |
| Baxter International, Inc. | 139 | 5 | 0,06 |
| Becton Dickinson & Co. | 70 | 11 | 0,11 |
| Biogen, Inc. | 41 | 13 | 0,13 |
| Boston Scientific Corp. | 552 | 10 | 0,11 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 552 | 38 | 0,40 |
| Cardinal Health, Inc. | 116 | 10 | 0,11 |
| Celgene Corp. | 172 | 21 | 0,22 |
| Cigna Corp. | 95 | 14 | 0,14 |
| Community Health Systems, Inc. | 358 | 9 | 0,10 |
| Eli Lilly & Co. | 323 | 27 | 0,28 |
| Express Scripts Holding Co. | 160 | 14 | 0,15 |
| Gilead Sciences, Inc. | 258 | 26 | 0,27 |
| HCA Holdings, Inc. | 585 | 40 | 0,41 |
| Humana, Inc. | 79 | 14 | 0,15 |
| Johnson & Johnson | 460 | 47 | 0,49 |
| McKesson Corp. | 44 | $ 9 | 0,09 |
| Merck & Co., Inc. | 681 | 36 | 0,38 |
| Mylan NV | 145 | 8 | 0,08 |
| Pfizer, Inc. | 2.310 | 75 | 0,78 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 168 | 12 | 0,12 |
| St Jude Medical, Inc. | 134 | 8 | 0,09 |
| Tenet Healthcare Corp. | 212 | 6 | 0,07 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 461 | 54 | 0,57 |
| | | 650 | 6,80 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 135 | 20 | 0,21 |
| ADT Corp. | 294 | 10 | 0,10 |
| Avis Budget Group, Inc. | 266 | 10 | 0,10 |
| Caterpillar, Inc. | 177 | 12 | 0,13 |
| CSX Corp. | 509 | 13 | 0,14 |
| Danaher Corp. | 117 | 11 | 0,11 |
| Deere & Co. | 240 | 18 | 0,19 |
| Emerson Electric Co. | 209 | 10 | 0,10 |
| FedEx Corp. | 120 | 18 | 0,19 |
| Fluor Corp. | 183 | 9 | 0,09 |
| General Electric Co. | 3.106 | 97 | 1,01 |
| Hertz Global Holdings, Inc. | 619 | 9 | 0,09 |
| Honeywell International, Inc. | 160 | 17 | 0,17 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 108 | 10 | 0,10 |
| Ingersoll-Rand PLC | 146 | 8 | 0,08 |
| L-3 Communications Holdings, Inc. | 87 | 10 | 0,11 |
| Norfolk Southern Corp. | 113 | 9 | 0,10 |
| Northrop Grumman Corp. | 173 | 33 | 0,34 |
| PACCAR, Inc. | 155 | 7 | 0,08 |
| Parker-Hannifin Corp. | 84 | 8 | 0,09 |
| Pitney Bowes, Inc. | 466 | 10 | 0,10 |
| Raytheon Co. | 146 | 18 | 0,19 |
| Republic Services, Inc. | 250 | 11 | 0,12 |
| Rockwell Collins, Inc. | 39 | 4 | 0,04 |
| RR Donnelley & Sons Co. | 1.193 | 17 | 0,18 |
| Ryder System, Inc. | 112 | 6 | 0,07 |
| Union Pacific Corp. | 244 | 19 | 0,20 |
| United Parcel Service, Inc. | 101 | 10 | 0,10 |
| United Technologies Corp. | 169 | 16 | 0,17 |
| Waste Management, Inc. | 227 | 12 | 0,13 |
| | | 462 | 4,83 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Activision Blizzard, Inc. | 608 | 24 | 0,25 |
| Alphabet, Inc. | 89 | 69 | 0,72 |
| Apple, Inc. | 1.420 | 149 | 1,56 |
| Arrow Electronics, Inc. | 173 | 9 | 0,10 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 120 | 10 | 0,11 |
| Avnet, Inc. | 238 | 10 | 0,11 |
| CA, Inc. | 336 | 10 | 0,10 |
| Cisco Systems, Inc. | 1.874 | 51 | 0,53 |
| Cognizant Technology Solutions Corp. | 157 | 9 | 0,10 |
| Corning, Inc. | 492 | 9 | 0,09 |
| eBay, Inc. | 164 | 5 | 0,05 |
| EMC Corp. | 594 | 15 | 0,16 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | 158 | 10 | 0,10 |
| Fiserv, Inc. | 117 | 11 | 0,11 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 3.270 | 50 | 0,52 |
| HP, Inc. | 3.270 | 39 | 0,41 |
| Ingram Micro, Inc. | 384 | 12 | 0,12 |
| Intel Corp. | 2.452 | 85 | 0,88 |
| International Business Machines Corp. | 704 | 97 | 1,01 |
| Intuit, Inc. | 97 | 9 | 0,10 |
| Juniper Networks, Inc. | 376 | 10 | 0,11 |
| MasterCard, Inc. | 214 | 21 | 0,22 |
| Maxim Integrated Products, Inc. | 288 | $ 11 | 0,11 |
| Microsoft Corp. | 2.161 | 120 | 1,25 |
| Motorola Solutions, Inc. | 196 | 13 | 0,14 |
| Oracle Corp. | 841 | 31 | 0,32 |
| QUALCOMM, Inc. | 148 | 7 | 0,08 |
| Seagate Technology PLC | 243 | 9 | 0,09 |
| Symantec Corp. | 465 | 10 | 0,10 |
| Texas Instruments, Inc. | 255 | 14 | 0,15 |
| Visa, Inc. | 507 | 39 | 0,41 |
| Western Union Co. | 617 | 11 | 0,12 |
| Xerox Corp. | 1.548 | 16 | 0,17 |
| Yahoo!, Inc. | 249 | 8 | 0,09 |
| | | 1.003 | 10,49 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Products & Chemicals, Inc. | 71 | 9 | 0,10 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 157 | 7 | 0,07 |
| Cliffs Natural Resources, Inc. | 2.150 | 3 | 0,03 |
| Dow Chemical Co. | 190 | 10 | 0,10 |
| El du Pont de Nemours & Co. | 159 | 11 | 0,11 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 2.773 | 19 | 0,19 |
| International Paper Co. | 277 | 11 | 0,11 |
| LyondellBasell Industries NV | 95 | 8 | 0,09 |
| Monsanto Co. | 95 | 9 | 0,10 |
| Mosaic Co. | 215 | 6 | 0,06 |
| Newmont Mining Corp. | 461 | 8 | 0,09 |
| PPG Industries, Inc. | 85 | 8 | 0,09 |
| Sherwin-Williams Co. | 35 | 9 | 0,09 |
| | | 118 | 1,23 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 5.548 | 191 | 2,00 |
| CenturyLink, Inc. | 768 | 19 | 0,20 |
| Frontier Communications Corp. | 3.854 | 18 | 0,19 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 332 | 9 | 0,09 |
| Verizon Communications, Inc. | 1.477 | 68 | 0,71 |
| | | 305 | 3,19 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 860 | 8 | 0,09 |
| Ameren Corp. | 287 | 12 | 0,13 |
| American Electric Power Co., Inc. | 264 | 15 | 0,16 |
| Calpine Corp. | 537 | 8 | 0,08 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 517 | 9 | 0,10 |
| CMS Energy Corp. | 314 | 11 | 0,12 |
| Consolidated Edison, Inc. | 296 | 19 | 0,20 |
| Dominion Resources, Inc. | 149 | 10 | 0,10 |
| DTE Energy Co. | 134 | 11 | 0,11 |
| Duke Energy Corp. | 266 | 19 | 0,20 |
| Edison International | 178 | 11 | 0,11 |
| Entergy Corp. | 300 | 21 | 0,21 |
| Exelon Corp. | 600 | 17 | 0,17 |
| FirstEnergy Corp. | 560 | 18 | 0,19 |
| MDU Resources Group, Inc. | 503 | 9 | 0,10 |
| NextEra Energy, Inc. | 101 | 11 | 0,11 |
| NiSource, Inc. | 216 | 4 | 0,04 |
| PG&E Corp. | 271 | 14 | 0,15 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 176 | 11 | 0,12 |
| PPL Corp. | 337 | 12 | 0,12 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 303 | 12 | 0,12 |
| SCANA Corp. | 80 | 5 | 0,05 |
| Sempra Energy | 100 | 9 | 0,10 |
| Southern Co. | 425 | 20 | 0,21 |
| TECO Energy, Inc. | 560 | 15 | 0,16 |
| WEC Energy Group, Inc. | 192 | 10 | 0,10 |
| Xcel Energy, Inc. | 310 | 11 | 0,12 |
| | | 332 | 3,47 |
| Summe USA | | 5.913 | 61,82 |
| Summe Stammaktien | | 9.411 | 98,39 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Volkswagen AG | 133 | $ 19 | 0,20 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Annaly Capital Management, Inc. | 1.551 | 15 | 0,15 |
| Iron Mountain, Inc. | 314 | 9 | 0,09 |
| Simon Property Group, Inc. | 57 | 11 | 0,12 |
| Weyerhaeuser Co. | 311 | 9 | 0,10 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 44 | 0,46 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 9.474** | **99,05** |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Anlagen** | **$ 9.474** | **99,05** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | $ 3 | 0,03 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2 | 2 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 1 | 0 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 452 | 4 | 0,04 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 28 | 28 | 0,29 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 4 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 9 | 9 | 0,09 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,01 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 3 | 0 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,09 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,01 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 5 | 1 | 0,01 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 2 | 1 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 21 | 23 | 0,24 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 190 | 2 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,01 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 85** | **0,89** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 6** | **0,06** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 9.565** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 30.06.2015 | $ 17 | $ 15 | 0,16 |

**(b) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 6.429 | $ 3.045 | $ 0 | $ 9.474 |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

**(c) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,05 | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| AT&T, Inc. | 5.846 | $ 208 |
| Apple, Inc | 1.597 | 201 |
| JPMorgan Chase & Co. | 2.658 | 181 |
| Exxon Mobil Corp. | 1.968 | 163 |
| Royal Dutch Shell PLC | 4.903 | 136 |
| Citigroup, Inc. | 2.189 | 121 |
| International Business Machines Corp. | 704 | 114 |
| Chevron Corp. | 1.101 | 104 |
| BP PLC | 15.394 | 99 |
| Hewlett-Packard Co. | 3.270 | 98 |
| Pfizer, Inc. | 2.922 | 98 |
| Microsoft Corp. | 2.161 | 96 |
| Wells Fargo & Co. | 1.652 | 93 |
| HSBC Holdings PLC | 10.044 | 91 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 1.254 | 89 |
| Total S.A. | 1.758 | 86 |
| Intel Corp. | 2.763 | 85 |
| General Electric Co. | 3.106 | 83 |
| American International Group | 1.322 | 82 |
| ConocoPhillips | 1.310 | 80 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| AT&T, Inc. | 1.134 | $ 38 |
| Apple, Inc | 177 | 20 |
| Pfizer, Inc. | 612 | 20 |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. | 100 | 15 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 118 | 14 |
| Lowe's Cos, Inc. | 156 | 12 |
| Ashland, Inc | 105 | 12 |
| Royal Bank of Canada | 205 | 12 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 617 | 11 |
| Intel Corp. | 311 | 11 |
| Eiffage S.A. | 166 | 11 |
| Home Depot, Inc. | 90 | 10 |
| Fifth Third Bancorp | 521 | 10 |
| Sony Corp. | 400 | 10 |
| CME Group, Inc./IL | 109 | 10 |
| Old Mutual PLC | 3.376 | 10 |
| Electric Power Development Co. Ltd. | 300 | 10 |
| JPMorgan Chase & Co. | 159 | 10 |
| American International Group | 169 | 10 |
| Legg Mason, Inc. | 228 | 10 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 51 | 10 |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 122 | 10 |
| CVS Health Corp. | 107 | 10 |
| Oracle Corp. | 271 | 10 |
| Altria Group, Inc. | 174 | 10 |
| Iberdrola S.A. | 1.481 | 10 |
| Citigroup, Inc. | 185 | 10 |
| American Financial Group Inc | 135 | 10 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 154 | 10 |
| Duke Energy Corp. | 147 | 10 |
| Bank of Montreal | 187 | 10 |
| Berkshire Hathaway, Inc | 74 | 10 |
| Qualcomm, Inc. | 204 | 10 |
| Celgene Corp. | 84 | 10 |
| Scana Corp. | 187 | 10 |
| Visa, Inc. | 125 | 10 |
| Gilead Sciences, Inc. | 93 | 10 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 3.014 | 10 |
| Amgen, Inc | 61 | 10 |
| 3M Co. | 63 | 10 |
| TJX Cos, Inc. | 139 | 10 |
| Rockwell Collins, Inc. | 106 | 10 |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc. | 89 | 9 |
| Bunge Ltd. | 111 | 8 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 200 | 8 |
| Nitto Denko Corp. | 100 | 7 |
| CK Hutchison Holdings Ltd | 500 | 7 |
| Paypal Holdings, Inc | 164 | 6 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BRASILIEN** | | | | |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 900 | $ 212 | 0,73 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 5.090 | 1.154 | 3,95 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 150 | 33 | 0,11 |
| Caixa Economica Federal | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.05.2019 | $ | 200 | 178 | 0,61 |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 300 | 275 | 0,94 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 100 | 93 | 0,32 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 100 | 94 | 0,32 |
| | | | 2.039 | 6,98 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd. | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 100 | 100 | 0,34 |
| **KANADA** | | | | |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 100 | 95 | 0,33 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| Avago Technologies Cayman Ltd. | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | $ | 50 | 49 | 0,17 |
| COA Summit CLO Ltd. | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.04.2023 | | 233 | 232 | 0,80 |
| Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd. | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 79 | 29 | 0,10 |
| Tencent Holdings Ltd. | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.05.2017 | | 100 | 100 | 0,34 |
| Wynn Macau Ltd. | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 300 | 266 | 0,91 |
| | | | 676 | 2,32 |
| **CHINA** | | | | |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.09.2025 | | 100 | 101 | 0,35 |
| Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd. | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | | 100 | 100 | 0,34 |
| | | | 201 | 0,69 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| Nykredit Realkredit | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 300 | 44 | 0,15 |
| Realkredit Danmark | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 2.200 | 320 | 1,10 |
| | | | 364 | 1,25 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| BPCE S.A. | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.03.2017 | £ | 100 | 148 | 0,51 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.03.2024 | $ | 800 | 848 | 2,90 |
| Dexia Credit Local S.A. | | | | |
| 1,375 % fällig am 18.09.2019 | € | 200 | 227 | 0,78 |
| | | | 1.223 | 4,19 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| FMS Wertmanagement | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.12.2017 | £ | 100 | 147 | 0,50 |
| SC Germany Auto UG haftungsbeschraenkt | | | | |
| 0,239 % fällig am 11.12.2023 | € | 381 | 413 | 1,42 |
| | | | 560 | 1,92 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| Hellenic Railways Organization S.A. | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | | 100 | 101 | 0,35 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 23.000 | 176 | 0,60 |
| 5,014 % fällig am 27.12.2017 | € | 100 | 101 | 0,34 |
| | | | 378 | 1,29 |
| **HONGKONG** | | | | |
| CNOOC Nexen Finance 2014 ULC | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | $ | 100 | $ 99 | 0,34 |
| CNPC General Capital Ltd. | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 200 | 200 | 0,68 |
| | | | 299 | 1,02 |
| **ITALIEN** | | | | |
| Aggregator of Loans Backed by Assets 5 SPV Srl | | | | |
| 1,449 % fällig am 20.04.2040 | € | 87 | 94 | 0,32 |
| Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | | 79 | 86 | 0,29 |
| Claris RMBS Srl | | | | |
| 1,019 % fällig am 28.12.2061 | | 582 | 634 | 2,17 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | $ | 200 | 201 | 0,69 |
| Mars 2600 Srl | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | € | 146 | 160 | 0,55 |
| | | | 1.175 | 4,02 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | $ | 100 | 100 | 0,34 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Demeter Investments BV for Swiss Re Ltd. | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2050 | | 200 | 200 | 0,69 |
| Globaldrive Auto Receivables BV | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | € | 178 | 194 | 0,66 |
| | | | 394 | 1,35 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Nova Ljubljanska Banka dd | | | | |
| 2,875 % fällig am 03.07.2017 | | 400 | 442 | 1,51 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | $ | 100 | 100 | 0,34 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Instituto de Credito Oficial | | | | |
| 4,530 % fällig am 17.03.2016 | CAD | 700 | 507 | 1,73 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| Swedbank Hypotek AB | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.03.2018 | $ | 100 | 99 | 0,34 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| Credit Suisse AG | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | £ | 100 | 147 | 0,50 |
| UBS Group AG | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 210 | 0,72 |
| | | | 357 | 1,22 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| Barclays PLC | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 221 | 0,76 |
| HBOS PLC | | | | |
| 6,750 % fällig am 21.05.2018 | $ | 100 | 109 | 0,37 |
| HSBC Holdings PLC | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 100 | 110 | 0,38 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 200 | 309 | 1,06 |
| Motor PLC | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2021 | $ | 109 | 109 | 0,37 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 100 | 109 | 0,37 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 200 | 300 | 1,03 |
| Severn Trent Utilities Finance PLC | | | | |
| 6,125 % fällig am 26.02.2024 | | 100 | 179 | 0,61 |
| | | | 1.446 | 4,95 |
| **USA** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Las Vegas Sands, LLC | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | $ | 486 | $ 481 | 1,65 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| AbbVie, Inc. | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | | 100 | 99 | 0,34 |
| ADT Corp. | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2042 | | 300 | 216 | 0,74 |
| AES Corp. | | | | |
| 3,414 % fällig am 01.06.2019 | | 200 | 184 | 0,63 |
| American International Group, Inc. | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.02.2024 | | 100 | 103 | 0,35 |
| Amgen, Inc. | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2043 | | 100 | 107 | 0,37 |
| AT&T, Inc. | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | | 100 | 92 | 0,32 |
| Bank of America Corp. | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | | 100 | 100 | 0,34 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 100 | 103 | 0,35 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2017 | | 100 | 107 | 0,37 |
| CCO Safari II LLC | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 100 | 100 | 0,34 |
| General Motors Financial Co., Inc. | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 150 | 150 | 0,52 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | | 100 | 102 | 0,35 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2019 | | 100 | 115 | 0,39 |
| International Lease Finance Corp. | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 200 | 206 | 0,71 |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | |
| 4,950 % fällig am 25.03.2020 | | 100 | 108 | 0,37 |
| Morgan Stanley | | | | |
| 7,300 % fällig am 13.05.2019 | | 100 | 115 | 0,39 |
| Nissan Motor Acceptance Corp. | | | | |
| 0,972 % fällig am 03.03.2017 | | 100 | 100 | 0,34 |
| Reynolds American, Inc. | | | | |
| 4,850 % fällig am 15.09.2023 | | 25 | 27 | 0,09 |
| Sprint Communications, Inc. | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.08.2017 | | 200 | 197 | 0,68 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2022 | | 200 | 200 | 0,68 |
| UnitedHealth Group, Inc. | | | | |
| 0,765 % fällig am 17.01.2017 | | 100 | 100 | 0,34 |
| Verizon Communications, Inc. | | | | |
| 4,522 % fällig am 15.09.2048 | | 7 | 6 | 0,02 |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | | 4 | 4 | 0,01 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | | 50 | 55 | 0,19 |
| | | | 2.696 | 9,23 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates | | | | |
| 1,322 % fällig am 25.10.2034 | | 215 | 200 | 0,69 |
| Alternative Loan Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 538 | 524 | 1,79 |
| BCAP LLC Trust | | | | |
| 0,381 % fällig am 26.03.2037 | | 102 | 100 | 0,34 |
| Bear Stearns Alternative-A Trust | | | | |
| 2,608 % fällig am 25.01.2036 | | 201 | 174 | 0,60 |
| Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 141 | 96 | 0,33 |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 1,081 % fällig am 15.06.2033 | | 500 | 496 | 1,70 |
| 2,174 % fällig am 10.09.2045 | | 2.570 | 209 | 0,72 |
| Commercial Mortgage Trust | | | | |
| 5,826 % fällig am 10.07.2038 | | 110 | 111 | 0,38 |
| HarborView Mortgage Loan Trust | | | | |
| 0,642 % fällig am 19.12.2036 (a) | | 706 | 495 | 1,69 |
| IndyMac INDX Mortgage Loan Trust | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.10.2036 | | 24 | 19 | 0,06 |
| 0,692 % fällig am 25.10.2036 | | 522 | 352 | 1,20 |
| JPMorgan Mortgage Trust (a) | | | | |
| 2,577 % fällig am 25.06.2037 | | 194 | 172 | 0,59 |
| 2,919 % fällig am 25.01.2037 | | 87 | 77 | 0,26 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,641 % fällig am 15.03.2039 | $ 562 | $ 563 | 1,93 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 1,047 % fällig am 25.09.2047 | 54 | 44 | 0,15 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 276 | 239 | 0,82 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,744 % fällig am 25.04.2035 | 195 | 187 | 0,64 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust (a)** | | | |
| 1,825 % fällig am 25.01.2037 | 7 | 6 | 0,02 |
| 1,972 % fällig am 25.04.2037 | 8 | 6 | 0,02 |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 | 7 | 6 | 0,02 |
| 2,300 % fällig am 25.12.2036 | 26 | 23 | 0,08 |
| 2,408 % fällig am 25.09.2036 | 13 | 12 | 0,04 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | |
| 0,732 % fällig am 25.06.2037 | 578 | 470 | 1,61 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,361 % fällig am 15.02.2027 | 700 | 695 | 2,38 |
| | | 5.276 | 18,06 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Franklin, Ohio, Tobacco Settlement Financing Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2047 | 300 | 259 | 0,89 |
| **Kanawha, West Virginia, Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | $ 100 | $ 87 | 0,29 |
| **Polk County, Iowa, Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | 20 | 20 | 0,07 |
| | | 366 | 1,25 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,210 % fällig am 25.01.2016 | 1.000 | 1.000 | 3,43 |
| 0,225 % fällig am 22.01.2016 | 500 | 500 | 1,71 |
| 0,325 % fällig am 03.03.2016 | 100 | 100 | 0,34 |
| | | 1.600 | 5,48 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 202 | 177 | 0,61 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 2.157 | 2.399 | 8,21 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,135 % fällig am 14.01.2016 | 100 | 100 | 0,34 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | 700 | 691 | 2,37 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 150 | 135 | 0,46 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | 300 | 299 | 1,02 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | $ 200 | $ 199 | 0,68 |
| 1,875 % fällig am 31.05.2022 - 31.08.2022 | 2.000 | 1.977 | 6,77 |
| 2,000 % fällig am 31.10.2021 - 15.08.2025 (c) | 1.300 | 1.279 | 4,38 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 - 30.06.2022 (c)(d) | 3.100 | 3.118 | 10,68 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | 100 | 100 | 0,34 |
| | | 10.474 | 35,86 |
| Summe USA | | 20.893 | 71,53 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (e)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 10.770 | 108 | 0,37 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 31.556** | **108,03** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 42 | $ (17) | (0,06) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 1 | 0 | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2016 | 15 | (6) | (0,02) |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 1 | 0 | 0,00 |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 12 | 2 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 5 | (5) | (0,02) |
| Mini MSCI Emerging Markets Index March Futures | Short | 03/2016 | 25 | 6 | 0,02 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 12 | 4 | 0,01 |
| US Treasury 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 10 | (3) | (0,01) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 1 | 0 | 0,00 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 14 | 9 | 0,03 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 6 | 4 | 0,02 |
| | | | | $ (6) | (0,02) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - US Treasury 2-Year Note March Futures | $ 105,500 | 19.02.2016 | 10 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 159,500 | 22.01.2016 | 10 | $ (6) | $ (3) | (0,01) |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | 154,500 | 22.01.2016 | 2 | (1) | 0 | 0,00 |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | 156,500 | 22.01.2016 | 3 | (3) | (2) | (0,01) |
| | | | | $ (10) | $ (5) | (0,02) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (11)** | **(0,04)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | (5,000 %) | 20.06.2020 | $ 792 | $ (4) | (0,01) |

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 % | 28.09.2017 | $ 24.900 | $ 6 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | 15.500 | (91) | (0,31) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 5.300 | (32) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 6.500 | (52) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 03.12.2025 | 2.300 | (22) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 1.750 | (19) | (0,07) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | € 100 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 100 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 18.03.2022 | £ 100 | (2) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 100 | 5 | 0,02 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,660 % | 09.11.2021 | MXN 2.600 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,980 % | 26.08.2024 | 1.200 | (2) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,360 % | 09.06.2025 | 4.100 | 1 | 0,01 |
| | | | | | $ (210) | (0,72) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (214)** | **(0,73)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

### OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | $ 1,040 | 04.01.2016 | € 477 | $ 4 | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,050 | 08.01.2016 | 400 | 4 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,100 | 21.04.2016 | 700 | 1 | 2 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | FBF | CNH 6,400 | 02.02.2016 | $ 47 | 1 | 2 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BRC | 6,500 | 02.02.2016 | 37 | 1 | 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 6,500 | 02.02.2016 | 480 | 10 | 8 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | FBF | 7,400 | 02.02.2016 | 47 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,400 | 02.02.2016 | 69 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BRC | 7,500 | 02.02.2016 | 37 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | MYC | 2,500 | 04.02.2016 | 480 | 3 | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | MYC | 2,500 | 18.02.2016 | 69 | 2 | 2 | 0,01 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BOA | 3,960 | 10.03.2016 | 200 | 1 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | 6,434 | 17.08.2016 | 200 | 1 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,440 | 17.08.2016 | 100 | 1 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 29 | $ 18 | 0,06 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BPS | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 6,980 % | 17.08.2016 | $ 400 | $ 20 | $ 8 | 0,03 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BRC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 7,000 % | 06.01.2016 | 7.000 | 8 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 03.10.2016 | 200 | 5 | 2 | 0,01 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 5,000 % | 19.10.2017 | 1.400 | 3 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | FBF | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 6,900 % | 02.02.2016 | 14.100 | 37 | 1 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,350 % | 12.09.2016 | 3.200 | 23 | 12 | 0,04 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,900 % | 04.02.2016 | 3.000 | 7 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | SOG | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 6,980 % | 17.08.2016 | 1.400 | 70 | 31 | 0,11 |
| | | | | | | | $ 173 | $ 54 | 0,19 |

### VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 700 | (1) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (2) | $ (1) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus Russian ruble | SOG | RUB 85,000 | 02.12.2016 | € 200 | $ (14) | $ (20) | (0,07) |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,103 | 08.01.2016 | 400 | (4) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | JPM | 1,130 | 04.03.2016 | 300 | (2) | (1) | (0,01) |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | 1,010 | 04.01.2016 | 666 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | MYC | BRL 1,500 | 06.09.2016 | $ 106 | (3) | (5) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | MYC | 2,270 | 06.09.2016 | 69 | (2) | (4) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 5,000 | 19.10.2017 | 225 | (29) | (25) | (0,08) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 3,750 | 27.11.2017 | 109 | (14) | (12) | (0,04) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH 6,400 | 02.02.2016 | 94 | (1) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 6,900 | 02.02.2016 | 138 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 7,000 | 02.02.2016 | 959 | (9) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 7,500 | 02.02.2016 | 73 | (1) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | MYC | 2,900 | 18.02.2016 | 200 | (2) | (3) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,980 | 17.08.2016 | 100 | (1) | (1) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | DUB | 3,750 | 27.10.2017 | 200 | (3) | (3) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | BOA | RUB 80,000 | 02.12.2016 | 200 | (11) | (15) | (0,05) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | MYC | BRL 0,950 | 06.01.2016 | 109 | (16) | (15) | (0,05) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 27.01.2016 | 300 | (4) | (2) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 5,000 | 19.10.2017 | 225 | (34) | (30) | (0,10) |
| | | | | | $ (154) | $ (137) | (0,47) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 04.02.2016 | $ 200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,700 % | 03.10.2016 | 200 | (6) | (4) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,000 % | 19.10.2017 | 300 | (3) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,460 % | 27.11.2017 | 2.100 | (38) | (10) | (0,04) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,525 % | 27.11.2017 | 1.700 | (35) | (7) | (0,03) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.11.2017 | 2.100 | (37) | (9) | (0,03) |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,960 % | 10.03.2016 | 2.800 | (6) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 12.09.2016 | 700 | (22) | (13) | (0,05) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 02.02.2016 | 1.500 | (17) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.10.2017 | 1.800 | (29) | (7) | (0,02) |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | SOG | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 6,440 % | 17.08.2016 | 14.100 | (30) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (223) | $ (52) | (0,18) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | $ 100 | $ (1) | $ (1) | $ 0 | (0,01) |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 400 | 2 | 3 | (1) | 0,01 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BPS | € 50 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | BOA | $ 100 | $ 12 | $ 14 | $ (2) | 0,04 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | DUB | BRL 5.000 | $ (20) | $ (7) | $ (13) | (0,07) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | GLM | 2.600 | (2) | 0 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | HUS | 1.000 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | DUB | 2.000 | (32) | (27) | (5) | (0,11) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BPS | 4.000 | (11) | (2) | (9) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BRC | 700 | (2) | (1) | (1) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | CBK | 2.400 | (6) | 0 | (6) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | DUB | 1.400 | (4) | (1) | (3) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | FBF | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | GLM | 1.000 | (3) | 0 | (3) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | MYC | BRL 3.000 | $ (8) | $ 1 | $ (9) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | DUB | 1.100 | (37) | 3 | (40) | (0,13) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | DUB | 300 | (9) | 0 | (9) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,560 % | 04.01.2021 | FBF | 1.100 | (27) | 0 | (27) | (0,09) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,600 % | 04.01.2021 | BPS | 1.900 | (49) | 0 | (49) | (0,17) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | CBK | 300 | (7) | 0 | (7) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 500 | (12) | 0 | (12) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | FBF | 300 | (7) | 1 | (8) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | GLM | 1.400 | (34) | 0 | (34) | (0,12) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | HUS | 500 | (12) | 0 | (12) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,700 % | 04.01.2021 | BOA | 21.300 | (373) | 21 | (394) | (1,28) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 14,820 % | 04.01.2021 | DUB | 4.000 | (39) | 3 | (42) | (0,13) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,460 % | 04.01.2021 | BPS | 18.000 | 1 | (1) | 2 | 0,01 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,740 % | 26.01.2020 | GLM | € 600 | (3) | (3) | 0 | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,710 % | 29.01.2020 | BOA | 600 | (2) | (1) | (1) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,993 % | 30.03.2020 | GLM | 900 | (12) | 0 | (12) | (0,04) |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 300 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | | | | | | $ (708) | $ (14) | $ (694) | (2,42) |

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE**

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | RAE Fundamental Emerging Markets Total Return | 17.873 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 30.242 | 15.06.2016 | BOA | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 759 | $ | 190 | BOA | $ 0 | $ (2) | $ (2) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 194 | BRL | 759 | BOA | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 100 | $ | 25 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 25 | BRL | 100 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.234 | | 4.660 | DUB | 0 | (56) | (56) | (0,19) |
| 01/2016 | BRL | 4.660 | $ | 1.190 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,04 |
| 01/2016 | | 128 | | 32 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 33 | BRL | 128 | FBF | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 400 | $ | 102 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 101 | BRL | 400 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 383 | | 1.500 | JPM | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 1.500 | $ | 486 | JPM | 106 | 0 | 106 | 0,36 |
| 01/2016 | | 1.997 | | 511 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 508 | BRL | 1.997 | MSB | 1 | (4) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | | 256 | | 1.000 | UAG | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 1.000 | $ | 324 | UAG | 71 | 0 | 71 | 0,24 |
| 01/2016 | $ | 644 | CAD | 895 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 895 | $ | 672 | JPM | 27 | 0 | 27 | 0,09 |
| 01/2016 | $ | 97 | CNH | 640 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 2.523 | $ | 389 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| 01/2016 | | 1.915 | | 291 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 615 | | 96 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| 01/2016 | | 1.539 | | 238 | DUB | 14 | 0 | 14 | 0,05 |
| 01/2016 | | 410 | | 64 | GLM | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 456 | € | 430 | CBK | 12 | 0 | 12 | 0,04 |
| 01/2016 | | 26 | | 24 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 23 | $ | 25 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.803 | | 6.184 | HUS | 0 | (120) | (120) | (0,41) |
| 01/2016 | $ | 327 | € | 301 | JPM | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.539 | | 5.071 | UAG | 0 | (30) | (30) | (0,10) |
| 01/2016 | | 2.091 | £ | 1.409 | JPM | 0 | (14) | (14) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 1.409 | $ | 2.124 | MSB | 47 | 0 | 47 | 0,16 |
| 01/2016 | $ | 36 | INR | 2.391 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 6.356 | $ | 96 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 161 | JPY | 19.800 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 311.483 | $ | 2.550 | GLM | 0 | (39) | (39) | (0,13) |
| 01/2016 | $ | 318 | JPY | 39.100 | JPM | 7 | 0 | 7 | 0,02 |
| 01/2016 | | 2.086 | | 252.583 | MSB | 14 | 0 | 14 | 0,05 |
| 01/2016 | | 36 | KRW | 40.824 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 82.813 | $ | 72 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 36 | KRW | 40.817 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 160 | | 181.408 | BRC | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| 01/2016 | | 36 | | 40.797 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 721 | | 819.935 | FBF | 0 | (24) | (24) | (0,08) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 90 | KRW | 101.983 | GLM | $ 0 | $ (3) | $ (3) | (0,01) |
| 01/2016 | | 36 | | 40.818 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 63 | | 71.363 | JPM | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 01/2016 | | 45 | | 51.008 | MSB | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 01/2016 | | 160 | | 181.480 | NGF | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| 01/2016 | KRW | 1.519.829 | $ | 1.301 | SCX | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 62 | RUB | 4.059 | SOG | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| 02/2016 | AUD | 150 | $ | 110 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 852 | AUD | 1.213 | CBK | 29 | 0 | 29 | 0,10 |
| 02/2016 | AUD | 1.063 | $ | 763 | SCX | 0 | (9) | (9) | (0,03) |
| 02/2016 | $ | 479 | BRL | 1.948 | BOA | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| 02/2016 | | 23 | | 92 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.000 | | 3.957 | DUB | 0 | (10) | (10) | (0,03) |
| 02/2016 | CAD | 895 | $ | 645 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 155 | CAD | 205 | JPM | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| 02/2016 | | 66 | € | 60 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.435 | | 2.224 | JPM | 0 | (16) | (16) | (0,06) |
| 02/2016 | € | 5.071 | $ | 5.542 | UAG | 30 | 0 | 30 | 0,10 |
| 02/2016 | $ | 677 | £ | 456 | BOA | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 50 | $ | 76 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 02/2016 | | 1.409 | | 2.091 | JPM | 14 | 0 | 14 | 0,05 |
| 02/2016 | $ | 213 | £ | 141 | JPM | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| 02/2016 | | 49 | HKD | 378 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.232 | JPY | 270.000 | BOA | 15 | 0 | 15 | 0,05 |
| 02/2016 | JPY | 130.000 | $ | 1.061 | BPS | 0 | (21) | (21) | (0,07) |
| 02/2016 | $ | 1.876 | JPY | 230.802 | JPM | 45 | 0 | 45 | 0,15 |
| 02/2016 | JPY | 252.583 | $ | 2.087 | MSB | 0 | (14) | (14) | (0,05) |
| 02/2016 | | 140.000 | | 1.140 | MSB | 0 | (25) | (25) | (0,09) |
| 02/2016 | TWD | 16.893 | | 520 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 199 | TWD | 6.554 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 1.101 | $ | 64 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 1.247 | | 356 | BOA | 53 | 0 | 53 | 0,18 |
| 05/2016 | | 1.973 | | 565 | CBK | 86 | 0 | 86 | 0,29 |
| 05/2016 | | 1.704 | | 483 | JPM | 70 | 0 | 70 | 0,24 |
| 05/2016 | | 419 | | 119 | MSB | 17 | 0 | 17 | 0,06 |
| 05/2016 | HUF | 6.741 | | 23 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 802 | | 208 | CBK | 18 | 0 | 18 | 0,06 |
| 08/2016 | CNH | 1.323 | | 200 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 08/2016 | | 1.323 | | 200 | HUS | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 08/2016 | $ | 145 | CNH | 972 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 08/2016 | CNH | 701 | $ | 106 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 08/2016 | $ | 427 | CNH | 2.865 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 08/2016 | CNH | 993 | $ | 150 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 08/2016 | | 661 | | 100 | SOG | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 08/2016 | | 291 | | 44 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 09/2016 | | 5.871 | | 889 | BPS | 19 | 0 | 19 | 0,07 |
| 10/2016 | BRL | 300 | | 71 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 10/2016 | | 1.820 | | 443 | CBK | 23 | 0 | 23 | 0,08 |
| 10/2016 | | 610 | | 150 | GLM | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| 10/2016 | | 1.960 | | 468 | JPM | 16 | 0 | 16 | 0,05 |
| 10/2016 | | 400 | | 98 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| 10/2016 | $ | 1.837 | CNH | 12.386 | BOA | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| 10/2016 | CNH | 16.736 | $ | 2.570 | CBK | 96 | 0 | 96 | 0,33 |
| 01/2017 | BRL | 150 | | 36 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 01/2021 | | 70 | | 11 | HUS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 936 | $ (451) | $ 485 | 1,66 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (327)** | **(1,12)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (i)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (900) | $ (900) | (3,08) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | (2.000) | (2.059) | (7,05) |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | | (600) | (647) | (2,22) |
| | | | $ (3.606) | (12,35) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (3.606)** | **(12,35)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 27.398** | **93,79** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 19 | $ 28 | 0,09 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 3 | 2 | 0,01 |

## Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 405 | $ 3 | $ 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 58 | 58 | 0,20 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 4 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 27 | 2 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 18 | 18 | 0,06 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 126 | 8 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 18 | 18 | 0,06 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 5 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 17 | 19 | 0,07 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 171 | 2 | 0,01 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 6 | 9 | 0,03 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 173** | **0,59** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 1.640** | **5,62** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 29.211** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.407 (auf Basis des Abrechnungsdatums) als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.307 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(e) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.670 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(g) Barmittel in Höhe von USD 442 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(h) Barmittel in Höhe von USD 170 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(i) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 108 | $ 31.448 | $ 0 | $ 31.556 |
| Finanzderivate[3] | (10) | (542) | 0 | (552) |
| Leerverkäufe | 0 | (3.606) | 0 | (3.606) |
| **Summen** | **$ 98** | **$ 27.300** | **$ 0** | **$ 27.398** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 98.255 | $ 134 | $ 98.389 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.702 | 0 | 1.702 |
| Finanzderivate[3] | (74) | (479) | 0 | (553) |
| Leerverkäufe | 0 | (12.442) | 0 | (12.442) |
| **Summen** | **$ (74)** | **$ 87.036** | **$ 134** | **$ 87.096** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(k) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| DEU | 0,600 % | 24.12.2015 | 14.01.2016 | $ 1.321 | $ (1.321) | (4,52) |

**(l) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 0,867 % | 10.12.2015 | 21.01.2016 | $ 1.717 | $ (1.720) | (5,89) |
| MSC | 0,828 % | 02.12.2015 | 13.01.2016 | 709 | (710) | (2,43) |
| NOM | 0,557 % | 08.12.2015 | 19.01.2016 | 887 | (889) | (3,04) |
| TDM | 0,746 % | 01.12.2015 | 12.01.2016 | 101 | (101) | (0,35) |
| TDM | 1,165 % | 18.12.2015 | 14.01.2016 | 3.016 | (3.019) | (10,33) |
| | | | | | $ (6.439) | (22,04) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 3 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(m) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (313) | $ 1.670 | $ 1.357 |
| BPS | (33) | 0 | (33) |
| BRC | (8) | 0 | (8) |
| CBK | 258 | (270) | (12) |
| DUB | (234) | (70) | (304) |
| FBF | (112) | 0 | (112) |
| GLM | (78) | 0 | (78) |
| GST | (1) | 0 | (1) |
| HUS | (129) | 0 | (129) |
| JPM | 235 | (270) | (35) |
| MSB | 45 | (20) | 25 |
| MYC | (40) | 0 | (40) |
| NGF | (6) | 0 | (6) |
| SCX | 7 | 0 | 7 |
| SOG | 5 | 0 | 5 |
| UAG | 77 | (260) | (183) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(n) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 108,03 | 111,50 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,04) | (0,09) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,73) | (1,47) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (1,12) | 0,93 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (12,35) | (14,10) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 1,93 |

## Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | $ | 16.300 | $ 16.649 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | 16.000 | 16.223 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.489.701 | 14.908 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 30.06.2022 | $ | 12.600 | 12.638 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | | 5.100 | 5.099 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,260 % fällig am 17.02.2016 | | 4.900 | 4.894 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 03.11.2015 | | 4.800 | 4.798 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 4.750 | 4.686 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.10.2015 | | 4.300 | 4.300 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,097 % fällig am 12.08.2015 | | 4.300 | 4.299 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | | 4.101 | 4.097 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.01.2016 | | 3.800 | 3.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,068 % fällig am 15.05.2015 | | 2.700 | 2.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,064 % fällig am 27.05.2015 | | 2.500 | 2.500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.08.2015 | | 2.400 | 2.400 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 2.391 | 2.379 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 31.08.2022 | | 2.300 | 2.295 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 2.200 | 2.199 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 22.02.2016 | JPY | 270.000 | 2.197 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 2.200 | 2.182 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 2.099 | 2.055 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2015 | | 2.000 | 2.000 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.04.2015 | | 1.800 | 1.800 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 1.300 | 1.691 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | $ | 25.200 | $ 25.636 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | 16.000 | 16.167 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.478.931 | 14.800 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 30.06.2022 | $ | 9.900 | 9.992 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | | 5.100 | 5.099 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,260 % fällig am 17.02.2016 | | 4.900 | 4.896 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 03.11.2015 | | 4.800 | 4.798 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 4.498 | 4.323 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.10.2015 | | 4.300 | 4.300 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,097 % fällig am 12.08.2015 | | 4.300 | 4.299 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,080 % fällig am 01.05.2015 | | 4.100 | 4.100 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | | 4.081 | 4.098 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 4.050 | 4.008 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.01.2016 | | 3.800 | 3.799 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 2.400 | 3.121 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 2.200 | 2.825 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 12.200 | 2.821 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,068 % fällig am 15.05.2015 | $ | 2.700 | 2.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,064 % fällig am 27.05.2015 | | 2.500 | 2.500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.08.2015 | | 2.400 | 2.400 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 2.380 | 2.387 |
| **Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.** | | | |
| 1,125 % fällig am 22.04.2019 | € | 2.000 | 2.290 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 22.02.2016 | JPY | 270.000 | 2.233 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.200 | 2.200 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 2.200 | 2.183 |

(a) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund

31. Dezember 2015

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 600 | $ 655 | 0,08 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| Banco Bradesco S.A. | | | | |
| 4,500 % fällig am 12.01.2017 | | 1.600 | 1.624 | 0,20 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | BRL | 2.500 | 611 | 0,08 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | | 25.400 | 5.989 | 0,74 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 12.200 | 2.766 | 0,34 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 92.600 | 16.746 | 2,08 |
| Caixa Economica Federal | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.05.2019 | $ | 2.800 | 2.492 | 0,31 |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 400 | 305 | 0,04 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 1.220 | 1.121 | 0,14 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 2.500 | 1.781 | 0,22 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 300 | 281 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | | 170 | 170 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 02.10.2023 | € | 100 | 68 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | $ | 200 | 151 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | | 900 | 709 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 200 | 192 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | $ | 1.900 | 1.686 | 0,21 |
| | | | 36.712 | 4,56 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd. | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 6.400 | 6.372 | 0,79 |
| **KANADA** | | | | |
| Bank of Nova Scotia | | | | |
| 2,050 % fällig am 30.10.2018 | | 1.400 | 1.404 | 0,17 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| Aimco CLO | | | | |
| 0,620 % fällig am 20.08.2020 | | 872 | 868 | 0,11 |
| Avago Technologies Cayman Ltd. | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | | 650 | 643 | 0,08 |
| Carlyle High Yield Partners X Ltd. | | | | |
| 0,540 % fällig am 19.04.2022 | | 2.219 | 2.161 | 0,27 |
| COA Summit CLO Ltd. | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.04.2023 | | 465 | 464 | 0,06 |
| Flagship CLO V | | | | |
| 0,800 % fällig am 20.09.2019 | | 332 | 330 | 0,04 |
| Gallatin CLO VII Ltd. | | | | |
| 1,591 % fällig am 15.07.2023 | | 1.174 | 1.167 | 0,14 |
| LCM X LP | | | | |
| 1,581 % fällig am 15.04.2022 | | 4.064 | 4.057 | 0,50 |
| Octagon Investment Partners XII Ltd. | | | | |
| 1,604 % fällig am 05.05.2023 | | 2.384 | 2.382 | 0,30 |
| Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd. | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 785 | 291 | 0,04 |
| Race Point V CLO Ltd. | | | | |
| 1,812 % fällig am 15.12.2022 | | 2.512 | 2.497 | 0,31 |
| Tencent Holdings Ltd. | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.05.2017 | | 3.800 | 3.805 | 0,47 |
| Voya CLO Ltd. | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 5.400 | 5.359 | 0,67 |
| Wynn Macau Ltd. | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 1.200 | 1.062 | 0,13 |
| | | | 25.086 | 3,12 |
| **CHINA** | | | | |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.09.2025 | | 8.300 | 8.428 | 1,05 |
| Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd. | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | | 7.500 | 7.491 | 0,93 |
| | | | 15.919 | 1,98 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| Nykredit Realkredit | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 3.100 | $ 451 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2016 | | 5.900 | 863 | 0,11 |
| Realkredit Danmark | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | | 28.400 | 4.134 | 0,51 |
| | | | 5.448 | 0,68 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| BPCE S.A. | | | | |
| 1,375 % fällig am 06.03.2017 | £ | 3.400 | 5.025 | 0,63 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.03.2024 | $ | 4.500 | 4.772 | 0,59 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 1,047 % fällig am 12.06.2017 | | 6.400 | 6.384 | 0,79 |
| Dexia Credit Local S.A. | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.07.2017 | £ | 3.600 | 5.356 | 0,67 |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 2.700 | 3.156 | 0,39 |
| | | | 24.693 | 3,07 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| Erste Abwicklungsanstalt | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.02.2017 | $ | 1.000 | 998 | 0,12 |
| FMS Wertmanagement | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.12.2017 | £ | 1.800 | 2.641 | 0,33 |
| SC Germany Auto UG haftungsbeschraenkt | | | | |
| 0,239 % fällig am 11.12.2023 | € | 5.901 | 6.411 | 0,80 |
| Volkswagen Bank GmbH | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | | 400 | 419 | 0,05 |
| | | | 10.469 | 1,30 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| Hellenic Railways Organization S.A. | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | | 3.400 | 3.435 | 0,43 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 1.450 | 1.405 | 0,17 |
| **HONGKONG** | | | | |
| CNOOC Nexen Finance 2014 ULC | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 3.300 | 3.283 | 0,41 |
| CNPC General Capital Ltd. | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 1.600 | 1.598 | 0,20 |
| 2,750 % fällig am 14.05.2019 | | 600 | 600 | 0,07 |
| | | | 5.481 | 0,68 |
| **IRLAND** | | | | |
| Depfa ACS Bank | | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | € | 6.000 | 6.724 | 0,84 |
| German Postal Pensions Securitisation 2 PLC | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.01.2017 | | 5.200 | 5.901 | 0,73 |
| Taurus CMBS UK Ltd. | | | | |
| 1,979 % fällig am 01.05.2022 | £ | 2.980 | 4.361 | 0,54 |
| | | | 16.986 | 2,11 |
| **ITALIEN** | | | | |
| Aggregator of Loans Backed by Assets 5 SPV Srl | | | | |
| 1,449 % fällig am 20.04.2040 | € | 174 | 189 | 0,02 |
| Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | | 906 | 986 | 0,12 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2016 | | 4.950 | 5.542 | 0,69 |
| 5,000 % fällig am 09.02.2018 | | 2.150 | 2.548 | 0,32 |
| Claris ABS Srl | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | | 3.291 | 3.522 | 0,44 |
| Claris RMBS Srl | | | | |
| 1,019 % fällig am 28.12.2061 | | 4.655 | 5.077 | 0,63 |
| Deco Gondola Srl | | | | |
| 1,358 % fällig am 22.02.2026 | | 1.980 | 2.140 | 0,27 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2023 | | 7.500 | 10.053 | 1,25 |
| Sunrise Srl | | | | |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | € | 1.424 | $ 1.549 | 0,19 |
| | | | 31.606 | 3,93 |
| **JAPAN** | | | | |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | | | | |
| 4,436 % fällig am 02.04.2024 | $ | 1.100 | 1.132 | 0,14 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.03.2022 | | 1.500 | 1.504 | 0,19 |
| **MEXIKO** | | | | |
| Cemex SAB de C.V. | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.01.2021 | | 700 | 676 | 0,08 |
| Mexico Government International Bond | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.06.2018 | MXN | 26.400 | 1.538 | 0,19 |
| 6,500 % fällig am 09.06.2022 | | 37.900 | 2.263 | 0,28 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2027 | | 136.400 | 8.593 | 1,07 |
| 8,000 % fällig am 07.12.2023 | | 10.000 | 649 | 0,08 |
| | | | 13.719 | 1,70 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | $ | 200 | 200 | 0,03 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | | 400 | 413 | 0,05 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 300 | 323 | 0,04 |
| Demeter Investments BV for Swiss Re Ltd. | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2050 | | 1.200 | 1.201 | 0,15 |
| Globaldrive Auto Receivables BV | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | € | 2.021 | 2.193 | 0,27 |
| Harbourmaster CLO 10 BV | | | | |
| 0,881 % fällig am 06.02.2024 | | 775 | 842 | 0,10 |
| Panther CDO IV BV | | | | |
| 0,304 % fällig am 20.03.2084 | | 121 | 127 | 0,02 |
| Telefonica Europe BV | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.09.2049 | | 500 | 573 | 0,07 |
| | | | 5.872 | 0,73 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 1.900 | 1.809 | 0,22 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 2,250 % fällig am 25.03.2022 | | 1.600 | 1.867 | 0,23 |
| 4,750 % fällig am 10.05.2018 | $ | 8.200 | 8.724 | 1,08 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 700 | 784 | 0,10 |
| | | | 11.375 | 1,41 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd. | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | | 4.900 | 4.897 | 0,61 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 5.800 | 6.805 | 0,84 |
| Banco Santander S.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 600 | 612 | 0,08 |
| Instituto de Credito Oficial | | | | |
| 4,530 % fällig am 17.03.2016 | CAD | 1.400 | 1.013 | 0,13 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 5,150 % fällig am 31.10.2028 | € | 4.400 | 6.371 | 0,79 |
| 5,150 % fällig am 31.10.2044 | | 1.300 | 2.006 | 0,25 |
| | | | 16.807 | 2,09 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| Swedbank Hypotek AB | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.03.2018 | $ | 4.300 | 4.260 | 0,53 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 1.000 | $ 1.013 | 0,13 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 3.100 | 3.243 | 0,40 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 500 | 571 | 0,07 |
| | | | 4.827 | 0,60 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 4.642 | 5.295 | 0,66 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 800 | 855 | 0,11 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.000 | 2.206 | 0,27 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | | 200 | 236 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 214 | 0,03 |
| **E-Carat 3 PLC** | | | | |
| 0,972 % fällig am 18.03.2022 | £ | 742 | 1.094 | 0,14 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 21.05.2018 | $ | 1.300 | 1.421 | 0,18 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.08.2025 | | 900 | 895 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 700 | 767 | 0,09 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.800 | 2.785 | 0,35 |
| **Motor PLC** | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2021 | $ | 1.510 | 1.509 | 0,19 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.07.2025 | | 200 | 207 | 0,02 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 1.600 | 1.736 | 0,21 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 600 | 901 | 0,11 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 26.02.2024 | | 2.300 | 4.119 | 0,51 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 100 | 152 | 0,02 |
| | | | 24.392 | 3,03 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Ally Auto Receivables Trust** | | | | |
| 0,480 % fällig am 15.02.2017 | $ | 202 | 202 | 0,03 |
| **Nissan Auto Lease Trust** | | | | |
| 0,480 % fällig am 15.09.2016 | | 564 | 564 | 0,07 |
| | | | 766 | 0,10 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.12.2020 | | 980 | 969 | 0,12 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 14.05.2018 | | 300 | 299 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 3,600 % fällig am 14.05.2025 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 14.05.2035 | | 100 | 98 | 0,01 |
| 4,700 % fällig am 14.05.2045 | | 100 | 98 | 0,01 |
| **ADT Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2021 | | 200 | 210 | 0,03 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 22.05.2019 | | 2.000 | 1.981 | 0,25 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2043 | | 4.300 | 4.585 | 0,57 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 400 | 398 | 0,05 |
| 2,450 % fällig am 30.06.2020 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | | 500 | 489 | 0,06 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 300 | 289 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2035 | | 100 | 93 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | | 100 | 92 | 0,01 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.04.2019 | | 400 | 401 | 0,05 |
| 3,300 % fällig am 11.01.2023 | | 3.100 | 3.056 | 0,38 |
| 3,875 % fällig am 01.08.2025 | | 1.100 | 1.119 | 0,14 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | | 600 | 621 | 0,08 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 2.600 | 2.690 | 0,33 |
| 5,000 % fällig am 13.05.2021 | $ | 200 | $ 219 | 0,03 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | | 3.000 | 3.228 | 0,40 |
| 5,700 % fällig am 24.01.2022 | | 100 | 113 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.08.2016 | | 1.230 | 1.266 | 0,16 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,764 % fällig am 08.05.2017 | | 5.000 | 4.989 | 0,62 |
| 5,300 % fällig am 15.03.2017 | | 1.900 | 1.977 | 0,25 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 100 | 110 | 0,01 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | | 3.700 | 3.744 | 0,47 |
| **BMW US Capital LLC** | | | | |
| 0,756 % fällig am 02.06.2017 | | 11.800 | 11.730 | 1,46 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.800 | 1.796 | 0,22 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,300 % fällig am 01.04.2016 | | 8.000 | 8.012 | 1,00 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 1.900 | 1.887 | 0,23 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 20.07.2018 | | 500 | 500 | 0,06 |
| 2,800 % fällig am 20.07.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 20.07.2022 | | 100 | 102 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 20.07.2025 | | 600 | 613 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 20.07.2035 | | 100 | 104 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 20.07.2045 | | 200 | 211 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | | 400 | 399 | 0,05 |
| 4,134 % fällig am 04.08.2025 | | 5.600 | 5.591 | 0,69 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.07.2017 | | 1.800 | 1.806 | 0,22 |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 850 | 852 | 0,11 |
| 3,450 % fällig am 10.04.2022 | | 3.100 | 2.978 | 0,37 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 900 | 908 | 0,11 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | | 1.600 | 1.636 | 0,20 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2019 | | 100 | 114 | 0,01 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 1,114 % fällig am 07.08.2018 | | 600 | 600 | 0,07 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 1.300 | 1.337 | 0,17 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,308 % fällig am 19.02.2017 | € | 500 | 544 | 0,07 |
| 0,870 % fällig am 25.04.2018 | $ | 5.400 | 5.365 | 0,67 |
| 4,950 % fällig am 25.03.2020 | | 1.600 | 1.736 | 0,22 |
| 6,300 % fällig am 23.04.2019 | | 100 | 112 | 0,01 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 1,600 % fällig am 30.06.2017 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 1,600 % fällig am 25.04.2018 | | 3.400 | 3.438 | 0,43 |
| 7,300 % fällig am 13.05.2019 | | 300 | 345 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 8,780 % fällig am 15.09.2016 | MXN | 13.200 | 769 | 0,10 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 0,972 % fällig am 03.03.2017 | $ | 2.500 | 2.494 | 0,31 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 15.09.2023 | | 25 | 27 | 0,00 |
| **Rio Oil Finance Trust Series 2014-3** | | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 300 | 221 | 0,03 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 125 | 122 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 125 | 119 | 0,02 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,042 % fällig am 15.09.2016 | | 4.500 | 4.528 | 0,56 |
| 4,522 % fällig am 15.09.2048 | | 7 | 6 | 0,00 |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | | 7.600 | 8.368 | 1,04 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,200 % fällig am 22.07.2020 | | 700 | 698 | 0,09 |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | | 600 | 599 | 0,07 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 01.04.2017 | | 1.100 | 1.095 | 0,14 |
| | | | 104.728 | 13,01 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,493 % fällig am 25.03.2036 (a) | $ | 1.871 | $ 1.425 | 0,18 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,322 % fällig am 25.10.2034 | | 860 | 801 | 0,10 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (a) | | 2.631 | 1.963 | 0,24 |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | | 6.527 | 4.957 | 0,62 |
| 1,257 % fällig am 25.12.2035 | | 64 | 54 | 0,01 |
| 2,307 % fällig am 20.10.2035 | | 3.565 | 3.190 | 0,40 |
| 2,678 % fällig am 25.12.2035 | | 3.694 | 3.433 | 0,43 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 87 | 80 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 7.528 | 7.338 | 0,91 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 1.109 | 806 | 0,10 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | | 1.379 | 1.272 | 0,16 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,919 % fällig am 25.08.2035 | | 3.231 | 3.197 | 0,40 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 2,608 % fällig am 25.01.2036 | | 2.957 | 2.563 | 0,32 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 1.272 | 861 | 0,11 |
| **Citigroup & Deutsche Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,289 % fällig am 11.12.2049 | | 785 | 805 | 0,10 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,081 % fällig am 15.06.2033 | | 6.200 | 6.144 | 0,76 |
| 2,174 % fällig am 10.09.2045 (b) | | 10.476 | 852 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,882 % fällig am 25.07.2035 | | 5.000 | 4.835 | 0,60 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 (a) | | 2.221 | 2.039 | 0,25 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,826 % fällig am 10.07.2038 | | 124 | 125 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.08.2035 | | 500 | 479 | 0,06 |
| 1,277 % fällig am 25.08.2034 | | 1.275 | 1.213 | 0,15 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | | 7 | 6 | 0,00 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | | 21 | 18 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.02.2035 | | 29 | 27 | 0,00 |
| 1,182 % fällig am 25.09.2034 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 2,629 % fällig am 20.02.2036 | | 1.166 | 1.005 | 0,12 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,311 % fällig am 15.12.2039 | | 847 | 856 | 0,11 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 3,914 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 180 | 180 | 0,02 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.09.2047 (a) | | 4.446 | 3.466 | 0,43 |
| **GP Portfolio Trust** | | | | |
| 1,281 % fällig am 15.02.2027 | | 1.031 | 1.029 | 0,13 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,642 % fällig am 19.12.2036 (a) | | 7.056 | 4.945 | 0,61 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.10.2036 | | 8.481 | 5.712 | 0,71 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,577 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 551 | 489 | 0,06 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,641 % fällig am 15.03.2039 | | 562 | 563 | 0,07 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.09.2036 | | 6.871 | 3.821 | 0,47 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 1.105 | 955 | 0,12 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.03.2036 | | 4.993 | 4.870 | 0,60 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,537 % fällig am 25.05.2034 | | 123 | 125 | 0,02 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,842 % fällig am 25.07.2044 | | 1.348 | 1.304 | 0,16 |
| 2,151 % fällig am 25.10.2046 | | 3.164 | 2.855 | 0,35 |
| 2,523 % fällig am 25.12.2035 | | 7.902 | 7.649 | 0,95 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 25.06.2037 | | 7.678 | 6.255 | 0,78 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,361 % fällig am 15.02.2027 | | 2.800 | 2.779 | 0,34 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust (a)** | | | |
| 2,747 % fällig am 25.09.2036 | $ 220 | $ 207 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | 31 | 30 | 0,00 |
| | | 97.587 | 12,12 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Franklin, Ohio, Tobacco Settlement Financing Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2047 | 3.700 | 3.203 | 0,40 |
| **Kanawha, West Virginia, Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | 880 | 763 | 0,10 |
| **Polk County, Iowa, Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | 20 | 20 | 0,00 |
| | | 3.986 | 0,50 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | |
| **Deutsche Bank Securities, Inc.** | | | |
| 0,350 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2043 bewertet mit $9.532. Die Rückkauferlöse betragen $9.300.) | 9.300 | 9.300 | 1,15 |
| **J.P. Morgan Securities LLC** | | | |
| 0,570 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2020 bewertet mit $26.056. Die Rückkauferlöse betragen $25.502.) | $ 25.500 | $ 25.500 | 3,17 |
| | | 34.800 | 4,32 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,190 % fällig am 06.01.2016 | 300 | 300 | 0,04 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,731 % fällig am 15.11.2043 | 2.090 | 2.096 | 0,26 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | 2.000 | 2.122 | 0,26 |
| | | 4.518 | 0,56 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 - 15.07.2024 | 31.558 | 30.012 | 3,73 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (d) | 5.874 | 5.612 | 0,70 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 3.939 | 3.444 | 0,43 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 28.160 | 31.323 | 3,89 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ 19.750 | $ 19.495 | 2,42 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 600 | 538 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 - 15.05.2045 | 5.100 | 5.079 | 0,63 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 (e) | 2.100 | 2.092 | 0,26 |
| 1,750 % fällig am 31.03.2022 (d)(e) | 17.000 | 16.741 | 2,08 |
| 1,875 % fällig am 31.05.2022 - 31.10.2022 (e) | 74.600 | 73.715 | 9,16 |
| 2,000 % fällig am 31.10.2021 - 15.08.2025 (f)(g) | 102.550 | 102.173 | 12,69 |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 (e)(g) | 77.600 | 78.296 | 9,73 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 (g) | 1.300 | 1.297 | 0,16 |
| | | 369.817 | 45,94 |
| Summe USA | | 617.171 | 76,67 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (h)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 14.447 | 144 | 0,02 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 893.580** | **111,01** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 855 | $ (344) | (0,04) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 19 | (9) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2016 | 170 | (72) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 3 | (2) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 10 | 4 | 0,00 |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 186 | 29 | 0,00 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 56 | 87 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 195 | (290) | (0,04) |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 100 | 33 | 0,01 |
| US Treasury 2-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 877 | 274 | 0,03 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 848 | (253) | (0,03) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 101 | 58 | 0,01 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 98 | 77 | 0,01 |
| | | | | $ (408) | (0,05) |

### OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - US Treasury 2-Year Note March Futures | $ 111,000 | 19.02.2016 | 900 | $ 14 | $ 14 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 500 | 5 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 19 | $ 18 | 0,00 |

### VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 159,500 | 22.01.2016 | 153 | $ (97) | $ (50) | 0,00 |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | 160,500 | 22.01.2016 | 130 | (54) | (17) | 0,00 |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | 154,500 | 22.01.2016 | 32 | (17) | (4) | 0,00 |
| Put - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | 156,500 | 22.01.2016 | 121 | (104) | (57) | (0,01) |
| | | | | $ (272) | $ (128) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (518)** | **(0,06)** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 33.066 | $ (1.057) | (0,13) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 24.300 | (205) | (0,03) |
| CDX.IG-23 Index | 1,000 % | 20.12.2019 | 16.800 | (132) | (0,02) |
| CDX.IG-24 Index | 1,000 % | 20.06.2020 | 66.300 | (79) | (0,01) |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 138.100 | (254) | (0,03) |
| | | | | $ (1.727) | (0,22) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt Variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 % | 28.09.2017 | $ 654.100 | $ (193) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | 224.800 | (1.325) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 5.100 | (60) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 260.900 | (5.688) | (0,71) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 % | 03.12.2025 | 39.200 | (382) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 40.900 | (579) | (0,07) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | € 1.300 | (9) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 18.03.2022 | £ 10.000 | (193) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 10.100 | (96) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 2.300 | 122 | 0,01 |
| | | | | | $ (8.403) | (1,04) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (10.130)** | **(1,26)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | $ 1,040 | 04.01.2016 | € 12.500 | $ 92 | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,050 | 08.01.2016 | 6.100 | 59 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | 1,050 | 08.01.2016 | 6.000 | 59 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,100 | 21.04.2016 | 17.400 | 29 | 58 | 0,01 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH 6,400 | 02.02.2016 | $ 6.771 | 183 | 208 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 6,500 | 02.02.2016 | 6.771 | 142 | 119 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | 7,400 | 02.02.2016 | 6.771 | 40 | 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 7,500 | 02.02.2016 | 6.771 | 37 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,443 | 16.08.2016 | 5.700 | 33 | 31 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | 6,434 | 17.08.2016 | 3.900 | 25 | 20 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,442 | 17.08.2016 | 3.800 | 20 | 21 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 6,444 | 17.08.2016 | 1.000 | 5 | 5 | 0,00 |
| | | | | | $ 724 | $ 463 | 0,06 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,700 % | 03.10.2016 | $ 37.600 | $ 72 | $ 7 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,750 % | 27.10.2017 | 23.500 | 1.171 | 486 | 0,06 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,750 % | 27.11.2017 | 15.900 | 794 | 350 | 0,04 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,350 % | 12.09.2016 | 6.900 | 189 | 77 | 0,01 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,950 % | 06.01.2016 | 95.000 | 105 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,900 % | 04.02.2016 | 178.400 | 419 | 2 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,900 % | 18.02.2016 | 175.200 | 456 | 6 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 % | 06.09.2016 | 93.700 | 678 | 363 | 0,05 |
| | | | | | | | $ 3.884 | $ 1.291 | 0,16 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | |
| Call - Fannie Mae | MYI | $ 113,000 | 06.01.2016 | 100.000.000 | $ 4 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 3.400 | $ (6) | $ (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 10.900 | (19) | (9) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 4.300 | (7) | (7) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 1.600 | (4) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (36) | $ (20) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus Russian ruble | HUS | RUB 85,000 | 02.12.2016 | € 2.900 | $ (189) | $ (295) | (0,04) |
| Call - OTC Euro versus Russian ruble | SOG | 85,000 | 02.12.2016 | 2.700 | (190) | (275) | (0,03) |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BPS | $ 1,102 | 08.01.2016 | 6.000 | (59) | (5) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,103 | 08.01.2016 | 6.100 | (59) | (4) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | JPM | 1,130 | 04.03.2016 | 7.200 | (58) | (28) | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | 1,010 | 04.01.2016 | 18.750 | (43) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | BOA | BRL 3,960 | 10.03.2016 | $ 549 | (18) | (28) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | JPM | 3,960 | 10.03.2016 | 2.596 | (83) | (132) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 5,000 | 19.10.2017 | 1.576 | (203) | (172) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 5,000 | 19.10.2017 | 4.713 | (597) | (514) | (0,06) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH 6,900 | 02.02.2016 | 13.541 | (143) | (13) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 7,000 | 02.02.2016 | 13.541 | (124) | (7) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,969 | 16.08.2016 | 5.700 | (67) | (73) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,975 | 17.08.2016 | 3.800 | (44) | (48) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 6,976 | 17.08.2016 | 1.000 | (12) | (13) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | 6,982 | 17.08.2016 | 3.900 | (48) | (49) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | BOA | RUB 80,000 | 02.12.2016 | 5.800 | (318) | (444) | (0,05) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,800 | 27.01.2016 | 8.100 | (119) | (60) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 5,000 | 19.10.2017 | 1.576 | (235) | (211) | (0,03) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 5,000 | 19.10.2017 | 4.713 | (711) | (631) | (0,08) |
| | | | | | $ (3.320) | $ (3.002) | (0,37) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 04.02.2016 | $ 3.100 | $ (6) | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 03.10.2016 | 8.000 | (72) | (25) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,460 % | 27.11.2017 | 18.100 | (330) | (87) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,525 % | 27.11.2017 | 19.700 | (407) | (86) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.11.2017 | 29.000 | (504) | (123) | (0,02) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 12.09.2016 | 6.900 | (191) | (127) | (0,02) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 06.01.2016 | 20.600 | (232) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 04.02.2016 | 175.300 | (368) | (5) | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,495 % | 18.02.2016 | 175.200 | (368) | (13) | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,272 % | 06.09.2016 | 21.300 | (677) | (404) | (0,05) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.10.2017 | 98.900 | (1.696) | (382) | (0,05) |
| | | | | | | | $ (4.851) | $ (1.252) | (0,16) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | BRC | $ 1.800 | $ (4) | $ (52) | $ 48 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 500 | (5) | (6) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 500 | (6) | (7) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 1.200 | (13) | (16) | 3 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | JPM | 400 | (4) | (4) | 0 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 10.100 | 52 | 77 | (25) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 300 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BPS | 450 | (1) | (6) | 5 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 350 | (1) | (5) | 4 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | GST | 50 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | JPM | 100 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | JPM | 150 | (1) | (3) | 2 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | MYC | 200 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ 16 | $ (30) | $ 46 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | BOA | $ 700 | $ 84 | $ 94 | $ (10) | 0,01 |
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | CBK | 700 | 84 | 93 | (9) | 0,01 |
| | | | | | $ 168 | $ 187 | $ (19) | 0,02 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | DUB | BRL 500 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | GLM | 40.300 | (24) | 0 | (24) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | HUS | 28.100 | (17) | (1) | (16) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | DUB | 26.200 | (424) | (354) | (70) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BPS | 56.700 | (153) | (11) | (142) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BRC | 9.800 | (26) | (10) | (16) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | CBK | 29.000 | (78) | (6) | (72) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | DUB | 52.900 | (143) | (30) | (113) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | FBF | 5.200 | (14) | 0 | (14) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | GLM | 10.000 | (27) | 2 | (29) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | MYC | 44.800 | (121) | 9 | (130) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | DUB | 35.400 | (1.183) | 114 | (1.297) | (0,15) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | GLM | 84.000 | (2.806) | (231) | (2.575) | (0,35) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | UAG | 23.000 | (768) | (51) | (717) | (0,10) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | GLM | 54.500 | (1.616) | 5 | (1.621) | (0,20) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,560 % | 04.01.2021 | FBF | 18.900 | (458) | (2) | (456) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,600 % | 04.01.2021 | BPS | 49.200 | (1.270) | 4 | (1.274) | (0,16) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,600 % | 04.01.2021 | DUB | 9.800 | (253) | 0 | (253) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | BOA | 100 | (2) | 1 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | CBK | 9.100 | (222) | (2) | (220) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 8.900 | (217) | (1) | (216) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | FBF | 6.500 | (158) | 18 | (176) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | GLM | 28.100 | (685) | 19 | (704) | (0,08) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | HUS | 25.700 | (627) | 33 | (660) | (0,08) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,740 % | 26.01.2020 | GLM | € 3.700 | (17) | (18) | 1 | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,710 % | 29.01.2020 | BOA | 7.600 | (22) | (9) | (13) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,660 % | 30.01.2020 | GLM | 16.900 | (3) | (2) | (1) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,700 % | 30.01.2020 | BPS | 6.000 | (14) | 0 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,993 % | 30.03.2020 | GLM | 13.000 | (170) | (2) | (168) | (0,02) |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 3.260 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | CBK | 180 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | FBF | 100 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | DUB | 1.784 | 15 | (2) | 17 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | JPM | 420 | 4 | 1 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | MYC | 1.370 | 11 | (2) | 13 | 0,00 |
| | | | | | | $ (11.443) | $ (528) | $ (10.915) | (1,42) |

### TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | RAE Fundamental Global Developed Total Return | 78.308 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 120.504 | 29.02.2016 | CBK | $ (3) | $ 0 | $ (3) | 0,00 |
| Erhalt | RAE Fundamental Global Developed Total Return | 220.884 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 339.907 | 31.03.2016 | CBK | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| Erhalt | RAE Fundamental Global Developed Total Return | 214.376 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 329.893 | 31.05.2016 | CBK | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 27 | $ 0 | $ 27 | 0,00 |

(1) Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 9.000 | $ | 2.257 | BOA | $ 0 | $ (18) | $ (18) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.305 | BRL | 9.000 | BOA | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 7.833 | $ | 2.006 | BPS | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.006 | BRL | 7.833 | BPS | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 7.700 | $ | 1.972 | BRC | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.935 | BRL | 7.700 | BRC | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.100 | $ | 538 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 529 | BRL | 2.100 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 4.369 | | 17.059 | DUB | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 17.059 | $ | 4.395 | DUB | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| 01/2016 | | 8.100 | | 2.074 | GLM | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.040 | BRL | 8.100 | GLM | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.071 | | 19.800 | JPM | 0 | (66) | (66) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 19.800 | $ | 6.409 | JPM | 1.404 | 0 | 1.404 | 0,17 |
| 01/2016 | | 47.792 | | 12.239 | MSB | 159 | 0 | 159 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 12.523 | BRL | 47.792 | MSB | 2 | (445) | (443) | (0,05) |
| 01/2016 | BRL | 12.000 | $ | 3.883 | UAG | 850 | 0 | 850 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 3.073 | BRL | 12.000 | UAG | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 7.985 | $ | 1.242 | BPS | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| 01/2016 | | 18.759 | | 2.895 | DUB | 165 | 0 | 165 | 0,02 |
| 01/2016 | | 5.527 | | 858 | GLM | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 925 | DKK | 6.288 | JPM | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 6.150 | $ | 902 | UAG | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.419 | € | 6.059 | CBK | 163 | 0 | 163 | 0,02 |
| 01/2016 | € | 316 | $ | 346 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 98.369 | | 104.829 | HUS | 0 | (2.029) | (2.029) | (0,25) |
| 01/2016 | | 752 | | 822 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.458 | € | 3.187 | JPM | 9 | (5) | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 6 | | 6 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 324 | $ | 356 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 98.737 | € | 90.515 | UAG | 109 | (520) | (411) | (0,05) |
| 01/2016 | £ | 19.150 | $ | 28.871 | MSB | 646 | 0 | 646 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 28.342 | £ | 19.150 | SCX | 0 | (116) | (116) | (0,01) |
| 01/2016 | INR | 22.556 | $ | 336 | HUS | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 28.985 | JPY | 3.555.038 | BOA | 567 | 0 | 567 | 0,07 |
| 01/2016 | | 3.681 | | 453.900 | CBK | 92 | 0 | 92 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 4.634.638 | $ | 37.942 | GLM | 0 | (585) | (585) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 5.093 | JPY | 625.700 | JPM | 108 | 0 | 108 | 0,01 |
| 01/2016 | | 518 | KRW | 587.412 | BOA | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | | 518 | | 587.308 | BPS | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.180 | | 2.471.684 | BRC | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| 01/2016 | | 518 | | 587.024 | DUB | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.950 | | 10.173.978 | FBF | 0 | (297) | (297) | (0,04) |
| 01/2016 | | 1.252 | | 1.418.710 | GLM | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| 01/2016 | | 518 | | 587.325 | HUS | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | | 540 | | 611.280 | JPM | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | | 631 | | 715.239 | MSB | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.180 | | 2.472.665 | NGF | 0 | (77) | (77) | (0,01) |
| 01/2016 | KRW | 20.231.873 | $ | 17.317 | SCX | 109 | 0 | 109 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 2.436 | | 1.780 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 13.069 | AUD | 18.604 | CBK | 441 | 0 | 441 | 0,05 |
| 02/2016 | AUD | 17 | $ | 12 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 16.062 | | 11.530 | SCX | 0 | (134) | (134) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 2.234 | BRL | 9.000 | BOA | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.033 | | 15.959 | DUB | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 1.788 | $ | 1.348 | JPM | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 380 | | 416 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 86.730 | | 94.802 | UAG | 520 | 0 | 520 | 0,06 |
| 02/2016 | £ | 491 | | 729 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.219 | | 1.831 | CBK | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.014 | £ | 1.990 | JPM | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 19.150 | $ | 28.344 | SCX | 116 | 0 | 116 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 336 | INR | 22.672 | FBF | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 3.555.038 | $ | 29.004 | BOA | 0 | (573) | (573) | (0,07) |
| 02/2016 | $ | 29.200 | JPY | 3.593.213 | JPM | 695 | 0 | 695 | 0,09 |
| 02/2016 | JPY | 1.400 | $ | 11 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 875 | | 101 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 25 | | 18 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 30.607 | | 931 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 237.830 | | 7.328 | BPS | 121 | 0 | 121 | 0,02 |
| 03/2016 | $ | 434 | MXN | 7.490 | BRC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 247.285 | $ | 14.183 | SOG | 0 | (63) | (63) | (0,01) |
| 04/2016 | BRL | 2.500 | | 699 | BPS | 87 | 0 | 87 | 0,01 |
| 04/2016 | DKK | 6.288 | | 928 | JPM | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 25.294 | | 7.212 | BOA | 1.072 | 0 | 1.072 | 0,13 |
| 05/2016 | | 34.569 | | 9.807 | JPM | 1.414 | 0 | 1.414 | 0,18 |
| 05/2016 | | 8.493 | | 2.410 | MSB | 349 | 0 | 349 | 0,04 |
| 05/2016 | ZAR | 1.427 | | 98 | MSB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 22.625 | | 5.884 | CBK | 501 | 0 | 501 | 0,06 |
| 07/2016 | | 37.286 | | 10.405 | GLM | 1.534 | 0 | 1.534 | 0,19 |
| 08/2016 | CNH | 25.806 | | 3.900 | BPS | 67 | 0 | 67 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 08/2016 | CNH 13.327 | $ 2.014 | HUS | $ 34 | $ 0 | $ 34 | 0,00 |
| 08/2016 | 25.133 | 3.800 | HUS | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| 08/2016 | $ 5.859 | CNH 38.678 | HUS | 0 | (114) | (114) | (0,01) |
| 08/2016 | CNH 18.861 | $ 2.850 | SCX | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| 08/2016 | 6.612 | 1.000 | SOG | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 08/2016 | 5.526 | 836 | UAG | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 09/2016 | 109.086 | 16.527 | BPS | 363 | 0 | 363 | 0,05 |
| 10/2016 | BRL 12.200 | 3.090 | CBK | 277 | 0 | 277 | 0,03 |
| 10/2016 | CNH 7.010 | 1.077 | CBK | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| 10/2016 | 271.908 | 41.646 | SCX | 1.449 | 0 | 1.449 | 0,18 |
| 01/2021 | BRL 1.150 | 177 | HUS | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | $ 14.122 | $ (5.575) | $ 8.547 | 1,06 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (5.205)** | **(0,65)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (j)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (8.900) | $ (8.901) | (1,10) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | (71.900) | (74.032) | (9,20) |
| | | | $ (82.933) | (10,30) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (82.933)** | **(10,30)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 794.794** | **98,74** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 19 | $ 13 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 343 | 506 | 0,06 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 20 | 20 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 56 | 39 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 544 | 544 | 0,07 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 5 | 5 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 19 | 2 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 6 | 6 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 2 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 170 | 170 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 92 | 92 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1.771 | 228 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 163 | 163 | 0,02 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 11 | 8 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 2 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 719 | 781 | 0,10 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 108 | 160 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 2.748** | **0,34** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 7.394** | **0,92** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 804.936** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(b) **Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.942 und Barmittel in Höhe von USD 311 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.793 und Barmittel von USD 584 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.845 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(g) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 59.388 und Barmittel in Höhe von USD 250 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(h) **Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(i) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 16.440 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(i) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

(k) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 144 | $ 893.436 | $ 0 | $ 893.580 |
| Finanzderivate[3] | (491) | (15.362) | 0 | (15.853) |
| Leerverkäufe | 0 | (82.933) | 0 | (82.933) |
| **Summen** | **$ (347)** | **$ 795.141** | **$ 0** | **$ 794.794** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 111.191 | $ 1.076.253 | $ 536 | $ 1.187.980 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 23.659 | 0 | 23.659 |
| Finanzderivate[3] | (2.178) | (2.130) | 0 | (4.308) |
| Leerverkäufe | 0 | (168.650) | 0 | (168.650) |
| **Summen** | **$ 109.013** | **$ 929.132** | **$ 536** | **$ 1.038.681** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(l) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Class E EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 4.405 | AUD | 6.001 | CBK | $ 0 | $ (39) | $ (39) | (0,01) |
| 01/2016 | | 19.549 | | 26.891 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 32.892 | $ | 23.663 | NAB | 0 | (267) | (267) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 28.663 | CAD | 39.587 | BOA | 0 | (164) | (164) | (0,02) |
| 01/2016 | CAD | 40.263 | $ | 30.216 | JPM | 1.231 | 0 | 1.231 | 0,15 |
| 01/2016 | $ | 507 | CAD | 676 | JPM | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | | 498 | CHF | 508 | BOA | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 30.263 | $ | 29.476 | BOA | 0 | (757) | (757) | (0,09) |
| 01/2016 | $ | 30.126 | CHF | 29.755 | JPM | 0 | (401) | (401) | (0,05) |
| 01/2016 | | 4.698 | DKK | 32.100 | BOA | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 32.100 | $ | 4.558 | SCX | 0 | (114) | (114) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 210.826 | € | 197.739 | BOA | 3.978 | 0 | 3.978 | 0,49 |
| 01/2016 | € | 193.115 | $ | 212.156 | BOA | 2.402 | (26) | 2.376 | 0,30 |
| 01/2016 | $ | 5.333 | € | 4.877 | BPS | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 115.271 | $ | 125.721 | CBK | 739 | (237) | 502 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 224.580 | € | 211.442 | CBK | 5.222 | (112) | 5.110 | 0,64 |
| 01/2016 | € | 565 | $ | 604 | DUB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.896 | | 12.616 | FBF | 0 | (306) | (306) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 100.957 | € | 95.281 | GLM | 2.546 | 0 | 2.546 | 0,32 |
| 01/2016 | € | 193.468 | $ | 211.416 | JPM | 1.251 | 0 | 1.251 | 0,16 |
| 01/2016 | | 914 | | 972 | NAB | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 209.572 | € | 197.204 | UAG | 4.651 | 0 | 4.651 | 0,58 |
| 01/2016 | € | 191.314 | $ | 208.912 | UAG | 1.140 | (52) | 1.088 | 0,14 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 567 | $ | 843 | CBK | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.894 | £ | 2.577 | CBK | 0 | (96) | (96) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 43.452 | $ | 65.504 | DUB | 1.460 | 0 | 1.460 | 0,18 |
| 01/2016 | $ | 60.417 | £ | 40.713 | JPM | 0 | (410) | (410) | (0,05) |
| 01/2016 | | 1.102 | | 729 | SCX | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.165 | JPY | 263.522 | BOA | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.254 | | 153.809 | GLM | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 9.161.215 | $ | 75.000 | GLM | 0 | (1.157) | (1.157) | (0,14) |
| 01/2016 | $ | 72.260 | JPY | 8.743.885 | JPM | 427 | 0 | 427 | 0,05 |
| 01/2016 | NOK | 17.489 | $ | 2.011 | SCX | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.017 | NOK | 17.489 | UAG | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| 01/2016 | | 343 | NZD | 515 | BOA | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.528 | SEK | 71.097 | CBK | 0 | (95) | (95) | (0,01) |
| 01/2016 | SEK | 71.097 | $ | 8.153 | SCX | 0 | (280) | (280) | (0,04) |
| 02/2016 | AUD | 26.891 | | 19.523 | JPM | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 33.883 | | 24.400 | BOA | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 29.755 | | 30.163 | JPM | 400 | 0 | 400 | 0,05 |
| 02/2016 | DKK | 32.100 | | 4.702 | BOA | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.054 | | 1.158 | BOA | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 211.281 | € | 192.147 | BOA | 0 | (2.404) | (2.404) | (0,30) |
| 02/2016 | | 108.456 | | 99.148 | CBK | 0 | (675) | (675) | (0,08) |
| 02/2016 | | 211.560 | | 193.468 | JPM | 0 | (1.247) | (1.247) | (0,16) |
| 02/2016 | | 201.609 | | 184.443 | UAG | 0 | (1.107) | (1.107) | (0,14) |
| 02/2016 | £ | 40.713 | $ | 60.419 | JPM | 408 | 0 | 408 | 0,05 |
| 02/2016 | $ | 2.971 | HKD | 23.017 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 92.470 | $ | 11.933 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 16.682 | | 4.301 | DUB | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 123.637 | | 1.024 | DUB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.743.885 | | 72.301 | JPM | 0 | (432) | (432) | (0,05) |
| 02/2016 | NOK | 17.489 | | 2.016 | UAG | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 71.097 | | 8.535 | CBK | 94 | 0 | 94 | 0,01 |
| 02/2016 | SGD | 5.364 | | 3.810 | SCX | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | | | | | | $ 26.205 | $ (10.582) | $ 15.623 | 1,94 |

**(m) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| JPS | 0,650 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | $ 18.048 | $ (18.058) | (2,24) |

**(n) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 0,867 % | 10.12.2015 | 21.01.2016 | $ 9.018 | $ (9.032) | (1,12) |
| BCY | 0,912 % | 10.12.2015 | 21.01.2016 | 5.961 | (5.971) | (0,74) |
| BPG | 1,013 % | 11.12.2015 | 22.01.2016 | 4.537 | (4.545) | (0,56) |
| MSC | 0,828 % | 02.12.2015 | 13.01.2016 | 25.295 | (25.330) | (3,15) |
| NOM | (0,101 %) | 04.12.2015 | 15.01.2016 | 1.291 | (1.292) | (0,16) |
| NOM | 0,557 % | 04.12.2015 | 15.01.2016 | 1.122 | (1.123) | (0,14) |
| TDM | 0,963 % | 22.12.2015 | 12.01.2016 | 12.532 | (12.543) | (1,56) |
| | | | | | $ (59.836) | (7,43) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 28 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(o) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 3.756 | $ (4.520) | $ (764) |
| BPS | (808) | 860 | 52 |
| BRC | (94) | 0 | (94) |
| CBK | 6.229 | 5.520 | 11.749 |
| DUB | (467) | (810) | (1.277) |
| FBF | (2.429) | 2.230 | (199) |
| GLM | (2.909) | 2.090 | (819) |
| GST | (14) | 0 | (14) |
| HUS | (3.061) | 3.840 | 779 |
| JPM | 4.712 | (4.620) | 92 |
| MSB | 697 | (370) | 327 |
| MYC | (543) | 200 | (343) |
| NAB | (288) | 350 | 62 |
| NGF | (77) | 0 | (77) |
| SCX | 1.121 | (1.120) | 1 |
| SOG | (328) | 500 | 172 |
| UAG | 4.921 | (6.420) | (1.499) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(p) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 111,01 | 109,21 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,06) | (0,21) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (1,26) | (1,42) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,65) | 1,23 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (10,30) | (15,50) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 2,18 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 64.726.512 | $ 647.741 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | $ | 116.300 | 119.369 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | 89.700 | 90.982 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 54.850 | 54.127 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 52.576 | 52.229 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.08.2022 | | 37.800 | 37.753 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | | 34.300 | 34.023 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,040 % fällig am 08.07.2015 | | 26.500 | 26.499 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 25.300 | 25.390 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 87.500 | 25.199 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 15.600 | 20.288 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 19.612 | 19.441 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,040 % fällig am 15.07.2015 | | 19.200 | 19.199 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 19.450 | 19.130 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 5,000 % fällig am 01.09.2040 | € | 12.150 | 18.843 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 54.400 | 17.647 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | $ | 17.300 | 17.204 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | 17.000 | 17.023 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 8.600 | 11.854 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,071 % fällig am 07.08.2015 | $ | 11.300 | 11.299 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 75.824.524 | $ 758.800 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | $ | 235.100 | 240.555 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 46.802 | 46.524 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 35.300 | 46.312 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2019 | $ | 44.200 | 44.744 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 35.100 | 34.768 |
| Fannie Mae | | | |
| 0,080 % fällig am 01.05.2015 | | 33.000 | 32.991 |
| Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A. | | | |
| 1,125 % fällig am 22.04.2019 | € | 27.700 | 31.377 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 28.950 | 28.609 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 31.10.2021 | | 28.100 | 28.218 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 30.11.2021 | | 20.600 | 20.571 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 5,000 % fällig am 01.09.2040 | € | 12.150 | 18.884 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 54.400 | 17.194 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | $ | 16.941 | 16.998 |
| Bank of America Corp. | | | |
| 1,482 % fällig am 01.04.2019 | | 16.300 | 16.409 |
| Bank Nederlandse Gemeenten NV | | | |
| 1,000 % fällig am 19.03.2019 | € | 12.500 | 14.126 |
| Spain Government Bond | | | |
| 4,400 % fällig am 31.10.2023 | | 9.800 | 13.454 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 12.100 | 12.287 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 8.600 | 11.860 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,071 % fällig am 07.08.2015 | $ | 11.300 | 11.299 |

(a) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,956 % fällig am 23.07.2018 | $ | 3.500 | $ 3.498 | 1,19 |
| **PUMA** | | | | |
| 2,855 % fällig am 18.10.2045 | AUD | 698 | 506 | 0,17 |
| 2,960 % fällig am 13.05.2045 | | 666 | 484 | 0,17 |
| | | | 4.488 | 1,53 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2018 | € | 700 | 713 | 0,24 |
| **Caixa Economica Federal** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.05.2019 | $ | 500 | 445 | 0,15 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 1.000 | 978 | 0,33 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 300 | 296 | 0,10 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 300 | 276 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 1.100 | 1.020 | 0,35 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 1.000 | 662 | 0,23 |
| | | | 4.390 | 1,49 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.09.2017 | € | 700 | 715 | 0,24 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | BRL | 57.300 | 14.006 | 4,76 |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | | 36.800 | 8.677 | 2,95 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 53.800 | 11.750 | 4,00 |
| | | | 35.148 | 11,95 |
| Summe Brasilien | | | 39.538 | 13,44 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | $ | 1.800 | 1.792 | 0,61 |
| **KANADA** | | | | |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2022 | | 997 | 964 | 0,33 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Aimco CLO** | | | | |
| 0,620 % fällig am 20.08.2020 | | 349 | 347 | 0,12 |
| **COA Summit CLO Ltd.** | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.04.2023 | | 233 | 232 | 0,08 |
| **Eagle I Ltd.** | | | | |
| 2,570 % fällig am 15.12.2039 | | 525 | 521 | 0,18 |
| **Flagship CLO V** | | | | |
| 0,800 % fällig am 20.09.2019 | | 106 | 106 | 0,04 |
| **Gallatin CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,591 % fällig am 15.07.2023 | | 294 | 292 | 0,10 |
| **LCM X LP** | | | | |
| 1,581 % fällig am 15.04.2022 | | 1.590 | 1.587 | 0,54 |
| **Lockwood Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 1,690 % fällig am 25.01.2024 | | 1.000 | 996 | 0,34 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 1,470 % fällig am 25.07.2023 | | 2.000 | 1.995 | 0,68 |
| **Octagon Investment Partners XII Ltd.** | | | | |
| 1,604 % fällig am 05.05.2023 | | 825 | 824 | 0,28 |
| **Race Point V CLO Ltd.** | | | | |
| 1,812 % fällig am 15.12.2022 | | 1.256 | 1.249 | 0,42 |
| **Stone Tower CLO VI Ltd.** | | | | |
| 0,535 % fällig am 17.04.2021 | | 338 | 336 | 0,11 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.05.2017 | | 1.200 | 1.202 | 0,41 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 1,655 % fällig am 17.07.2024 | | 900 | 895 | 0,30 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 600 | 531 | 0,18 |
| | | | 11.113 | 3,78 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CHINA** | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | $ | 2.000 | $ 1.997 | 0,68 |
| **ZYPERN** | | | | |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.05.2022 | € | 400 | 453 | 0,15 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 1,156 % fällig am 17.06.2017 | $ | 1.500 | 1.498 | 0,51 |
| 1,375 % fällig am 06.03.2017 | £ | 1.200 | 1.774 | 0,60 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.03.2024 | $ | 1.400 | 1.485 | 0,50 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,047 % fällig am 12.06.2017 | | 1.500 | 1.496 | 0,51 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.07.2017 | £ | 1.200 | 1.785 | 0,61 |
| | | | 8.038 | 2,73 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Driver Twelve GmbH** | | | | |
| 0,152 % fällig am 22.05.2020 | € | 753 | 815 | 0,28 |
| **Erste Abwicklungsanstalt** | | | | |
| 1,000 % fällig am 27.02.2017 | $ | 600 | 599 | 0,20 |
| **SC Germany Auto UG haftungsbeschraenkt** | | | | |
| 0,239 % fällig am 11.12.2023 | € | 1.599 | 1.738 | 0,59 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,306 % fällig am 27.11.2017 | | 1.000 | 1.046 | 0,36 |
| | | | 4.198 | 1,43 |
| **GRIECHENLAND** | | | | |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 60.000 | 449 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 111.000 | 889 | 0,30 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,028 % fällig am 17.03.2017 | € | 200 | 202 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 74.000 | 566 | 0,19 |
| | | | 2.106 | 0,72 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.01.2018 | $ | 800 | 798 | 0,27 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 800 | 797 | 0,27 |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 800 | 796 | 0,27 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 400 | 399 | 0,14 |
| | | | 2.790 | 0,95 |
| **INDIEN** | | | | |
| **Bharti Airtel International Netherlands BV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.05.2021 | € | 100 | 114 | 0,04 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Bilkreditt 4 Ltd.** | | | | |
| 0,249 % fällig am 25.12.2027 | | 892 | 970 | 0,33 |
| **Bosphorus CLO** | | | | |
| 1,077 % fällig am 10.11.2023 | | 537 | 582 | 0,20 |
| **Cordatus CLO I PLC** | | | | |
| 0,283 % fällig am 30.01.2024 | | 1.324 | 1.427 | 0,49 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 27.11.2028 | | 1.200 | 1.303 | 0,44 |
| **Taurus CMBS UK Ltd.** | | | | |
| 1,979 % fällig am 01.05.2022 | £ | 966 | 1.414 | 0,48 |
| **Taurus Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 22.04.2028 | € | 700 | 761 | 0,26 |
| | | | 6.457 | 2,20 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets 5 SPV Srl** | | | | |
| 1,449 % fällig am 20.04.2040 | | 87 | 94 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl** | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | € | 236 | $ 257 | 0,09 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2016 | | 1.300 | 1.456 | 0,49 |
| 5,000 % fällig am 09.02.2018 | | 1.300 | 1.540 | 0,52 |
| **Claris RMBS Srl** | | | | |
| 1,019 % fällig am 28.12.2061 | | 1.746 | 1.904 | 0,65 |
| **Deco Gondola Srl** | | | | |
| 1,358 % fällig am 22.02.2026 | | 810 | 876 | 0,30 |
| **Marche Mutui 4 Srl** | | | | |
| 0,342 % fällig am 25.02.2055 | | 687 | 732 | 0,25 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,616 % fällig am 27.11.2031 | | 1.880 | 2.044 | 0,70 |
| 0,866 % fällig am 27.05.2031 | | 427 | 465 | 0,16 |
| **Taurus IT Srl** | | | | |
| 1,414 % fällig am 18.02.2027 | | 1.653 | 1.778 | 0,60 |
| | | | 11.146 | 3,79 |
| **JAPAN** | | | | |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.07.2022 | | 1.000 | 1.106 | 0,38 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,436 % fällig am 02.04.2024 | $ | 400 | 411 | 0,14 |
| | | | 1.517 | 0,52 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,082 % fällig am 20.08.2021 | € | 581 | 631 | 0,21 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2027 | MXN | 39.100 | 2.463 | 0,84 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Beluga Master Issuer BV** | | | | |
| 0,096 % fällig am 28.10.2099 | € | 2.100 | 2.277 | 0,78 |
| **Cadogan Square CLO IV BV** | | | | |
| 0,279 % fällig am 24.07.2023 | | 982 | 1.059 | 0,36 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | | 594 | 645 | 0,22 |
| **Malin CLO BV** | | | | |
| 0,199 % fällig am 07.05.2023 | | 501 | 541 | 0,18 |
| **Telefonica Europe BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.09.2049 | | 200 | 229 | 0,08 |
| | | | 4.751 | 1,62 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 0,720 % fällig am 28.07.2016 | JPY | 200.000 | 1.657 | 0,56 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2016 | $ | 1.800 | 1.824 | 0,62 |
| | | | 3.481 | 1,18 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 | € | 600 | 95 | 0,03 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 600 | 663 | 0,22 |
| 5,500 % fällig am 26.10.2022 | | 2.700 | 3.024 | 1,03 |
| | | | 3.687 | 1,25 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,107 % fällig am 26.11.2016 | | 1.000 | 1.001 | 0,34 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | | 1.300 | 1.299 | 0,44 |
| | | | 2.300 | 0,78 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Ibercaja Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 28.07.2025 | € | 1.700 | 1.773 | 0,60 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Instituto de Credito Oficial** | | | | |
| 4,530 % fällig am 17.03.2016 | CAD | 700 | $ 506 | 0,17 |
| | | | 2.279 | 0,77 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | |
| 1,375 % fällig am 29.05.2018 | $ | 2.400 | 2.375 | 0,80 |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 1,250 % fällig am 23.05.2018 | | 500 | 493 | 0,17 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | |
| 1,375 % fällig am 28.03.2018 | | 1.300 | 1.288 | 0,44 |
| | | | 4.156 | 1,41 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | £ | 1.400 | 2.063 | 0,70 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,264 % fällig am 01.06.2020 | $ | 3.800 | 3.790 | 1,29 |
| | | | 5.853 | 1,99 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,022 % fällig am 15.06.2018 | | 1.900 | 1.899 | 0,64 |
| **E-Carat 3 PLC** | | | | |
| 0,972 % fällig am 18.03.2022 | £ | 391 | 576 | 0,20 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,733 % fällig am 15.06.2044 | | 519 | 713 | 0,24 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | | 673 | 995 | 0,34 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 0,687 % fällig am 01.09.2016 | € | 1.000 | 1.088 | 0,37 |
| **Landmark Mortgage Securities No. 3 PLC** | | | | |
| 0,859 % fällig am 17.04.2044 | £ | 1.449 | 1.934 | 0,66 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 800 | 1.142 | 0,39 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.400 | 2.166 | 0,74 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 1,181 % fällig am 01.01.2061 | | 654 | 904 | 0,31 |
| **Motor PLC** | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2021 | $ | 1.422 | 1.421 | 0,48 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.10.2041 | £ | 540 | 713 | 0,24 |
| **Penarth Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,760 % fällig am 18.05.2019 | $ | 1.800 | 1.795 | 0,61 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | | 2.000 | 2.325 | 0,79 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.100 | 1.651 | 0,56 |
| | | | 19.322 | 6,57 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | | |
| 2,470 % fällig am 18.09.2024 | $ | 500 | 500 | 0,17 |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 0,967 % fällig am 20.01.2016 | | 2.300 | 2.299 | 0,78 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADT Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2042 | | 1.200 | 864 | 0,29 |
| **AES Corp.** | | | | |
| 3,414 % fällig am 01.06.2019 | | 1.000 | 920 | 0,31 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 22.05.2019 | | 600 | 594 | 0,20 |
| 2,200 % fällig am 22.05.2019 | | 1.400 | 1.399 | 0,48 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,482 % fällig am 01.04.2019 | | 5.900 | 5.879 | 2,00 |
| 2,650 % fällig am 01.04.2019 | | 2.000 | 2.007 | 0,68 |
| 3,625 % fällig am 17.03.2016 | | 800 | 804 | 0,27 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,764 % fällig am 08.05.2017 | | 300 | 299 | 0,10 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | | 2.000 | 2.024 | 0,69 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 13.02.2026 | $ | 1.000 | $ 1.018 | 0,35 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 1.800 | 1.863 | 0,63 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2018 | | 300 | 317 | 0,11 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 10.07.2017 | | 800 | 803 | 0,27 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,048 % fällig am 22.05.2017 | | 600 | 599 | 0,21 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 125 | 129 | 0,04 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 300 | 268 | 0,09 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,308 % fällig am 19.02.2017 | € | 700 | 762 | 0,26 |
| 0,882 % fällig am 15.02.2017 | $ | 2.500 | 2.499 | 0,85 |
| 4,950 % fällig am 25.03.2020 | | 1.000 | 1.085 | 0,37 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.12.2017 | | 1.300 | 1.253 | 0,43 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 3.200 | 3.187 | 1,08 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 1,600 % fällig am 25.04.2018 | | 1.000 | 1.011 | 0,35 |
| 2,125 % fällig am 25.04.2018 | | 100 | 100 | 0,04 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 0,972 % fällig am 03.03.2017 | | 1.300 | 1.297 | 0,44 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 1.600 | 1.419 | 0,48 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 15.09.2023 | | 25 | 27 | 0,01 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 600 | 623 | 0,21 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | | 1.985 | 2.025 | 0,69 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 1.100 | 1.048 | 0,36 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | | 33 | 36 | 0,01 |
| | | | 36.163 | 12,30 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.06.2035 | | 1.400 | 1.207 | 0,41 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 0,957 % fällig am 25.02.2047 | | 860 | 519 | 0,18 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | | 1.100 | 989 | 0,34 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.06.2034 | | 600 | 509 | 0,17 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 | | 203 | 187 | 0,06 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 2,601 % fällig am 25.05.2035 | | 140 | 138 | 0,05 |
| 2,702 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 1.576 | 1.143 | 0,39 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 1,072 % fällig am 25.03.2035 | | 2.500 | 2.367 | 0,80 |
| **Bear Stearns Structured Products Trust** | | | | |
| 1,722 % fällig am 25.03.2037 | | 2.500 | 2.309 | 0,78 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.07.2037 | | 1.000 | 937 | 0,32 |
| **Citigroup & Deutsche Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,289 % fällig am 11.12.2049 | | 357 | 366 | 0,12 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,081 % fällig am 15.06.2033 | | 1.800 | 1.784 | 0,61 |
| 2,174 % fällig am 10.09.2045 | | 2.857 | 232 | 0,08 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.06.2036 | | 819 | 807 | 0,27 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,961 % fällig am 25.05.2040 | | 11 | 10 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,708 % fällig am 25.06.2035 | | 707 | 676 | 0,23 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.09.2037 | | 963 | 825 | 0,28 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.05.2036 | | 1.300 | 1.097 | 0,37 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 (a) | | $ 664 | $ 638 | 0,22 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 25.12.2035 | | 577 | 519 | 0,18 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 1,467 % fällig am 14.08.2031 | | 1.128 | 1.124 | 0,38 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2046 | | 1.000 | 881 | 0,30 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | | 995 | 545 | 0,19 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 260 | 218 | 0,07 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.09.2036 | | 218 | 195 | 0,07 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 | | 1.684 | 1.604 | 0,55 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 | | 733 | 558 | 0,19 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 679 | 689 | 0,23 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,237 % fällig am 25.06.2046 | | 89 | 83 | 0,03 |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | | 612 | 576 | 0,20 |
| 4,151 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 991 | 878 | 0,30 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,361 % fällig am 15.02.2027 | | 900 | 893 | 0,30 |
| | | | 25.503 | 8,67 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2008** | | | | |
| 5,630 % fällig am 01.01.2022 | | 700 | 692 | 0,23 |
| **Polk County, Iowa, Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | | 20 | 20 | 0,01 |
| | | | 712 | 0,24 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,260 % fällig am 17.02.2016 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **Fannie Mae TBA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | | 12.000 | 12.675 | 4,31 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2046 | | 14.000 | 15.097 | 5,13 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 0,190 % fällig am 06.01.2016 | | 2.600 | 2.600 | 0,88 |
| 0,195 % fällig am 10.02.2016 | | 800 | 800 | 0,27 |
| 0,225 % fällig am 22.01.2016 | | 3.400 | 3.400 | 1,15 |
| 0,230 % fällig am 27.01.2016 | | 1.400 | 1.400 | 0,48 |
| 0,240 % fällig am 25.01.2016 | | 1.200 | 1.200 | 0,41 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 1.900 | 1.900 | 0,65 |
| 0,310 % fällig am 28.01.2016 | | 700 | 700 | 0,24 |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | | 2.200 | 2.199 | 0,75 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,762 % fällig am 20.06.2065 | | 2.293 | 2.268 | 0,77 |
| 0,792 % fällig am 20.07.2065 | | 3.396 | 3.381 | 1,15 |
| 0,872 % fällig am 20.11.2065 | | 883 | 883 | 0,30 |
| | | | 48.603 | 16,52 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 - 15.07.2024 (c)(d) | | 55.517 | 53.975 | 18,35 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 502 | 480 | 0,17 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 602 | 583 | 0,20 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 6.204 | 7.360 | 2,50 |
| | | | 62.398 | 21,22 |
| Summe USA | | | 176.178 | 59,90 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (e)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 14.726 | 147 | 0,05 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | $ 322.054 | 109,50 |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 191 | $ (77) | (0,03) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 162 | (79) | (0,03) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 157 | (69) | (0,02) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2018 | 140 | (118) | (0,04) |
| 90-Day Sterling December Futures | Short | 12/2016 | 65 | 10 | 0,00 |
| 90-Day Sterling June Futures | Short | 06/2017 | 137 | (68) | (0,02) |
| 90-Day Sterling March Futures | Short | 03/2017 | 556 | (122) | (0,04) |
| 90-Day Sterling September Futures | Short | 09/2017 | 171 | 58 | 0,02 |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 91 | (183) | (0,06) |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 17 | (3) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 2 | (2) | 0,00 |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 6 | 0 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 38 | (15) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 175 | 17 | 0,01 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 60 | (14) | 0,00 |
| | | | | $ (665) | (0,22) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (665)** | **(0,22)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | $ 15.500 | $ (445) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 05.08.2025 | 24.100 | 99 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 2.800 | (220) | (0,08) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | £ 3.600 | (37) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | 22.000 | (168) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 % | 15.06.2018 | 3.900 | 20 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 17.06.2018 | 70.000 | (669) | (0,23) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 15.000 | 145 | 0,05 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,535 % | 11.06.2020 | MXN 61.700 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,430 % | 17.11.2021 | 78.700 | (27) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,940 % | 13.07.2022 | 49.200 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,500 % | 02.09.2022 | 3.400 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,665 % | 23.01.2025 | 68.500 | (20) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,530 % | 05.06.2025 | 90.400 | 19 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,600 % | 21.05.2029 | 43.100 | (38) | (0,01) |
| | | | | | $ (1.343) | (0,46) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.343)** | **(0,46)** |

## FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,800 % | 20.01.2016 | $ 75.000 | $ 7 | $ 0 | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,100 % | 29.01.2016 | $ 18.000 | $ 68 | $ 4 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,940 % | 20.08.2018 | 500 | 49 | 45 | 0,02 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,100 % | 30.01.2018 | 4.200 | 60 | 40 | 0,01 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,580 % | 12.05.2016 | 2.000 | 64 | 14 | 0,01 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,580 % | 23.05.2016 | 4.600 | 130 | 36 | 0,01 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,020 % | 21.08.2017 | 1.200 | 81 | 69 | 0,02 |
| | | | | | | | $ 452 | $ 208 | 0,07 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,082 | 15.01.2016 | € 4.300 | $ (27) | $ (23) | (0,01) |
| Put - OTC Euro versus US dollar | CBK | 1,078 | 22.01.2016 | 2.900 | (21) | (18) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | BRL 4,450 | 14.01.2016 | $ 1.800 | (37) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,600 | 14.03.2016 | 1.500 | (42) | (14) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 4,550 | 17.03.2016 | 1.000 | (25) | (12) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 6,850 | 01.06.2016 | 1.100 | (10) | (13) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Mexican peso | GLM | MXN 17,400 | 05.02.2016 | 1.100 | (11) | (12) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Mexican peso | GLM | 17,650 | 08.03.2016 | 1.100 | (12) | (14) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | RUB 72,500 | 24.02.2016 | 800 | (16) | (32) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 74,000 | 09.03.2016 | 300 | (5) | (11) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | 87,000 | 08.12.2016 | 700 | (30) | (37) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BRC | JPY 91,000 | 18.02.2016 | 1.000 | (24) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | GLM | 91,000 | 18.02.2016 | 600 | (14) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | JPM | 91,000 | 18.02.2016 | 3.200 | (80) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BRC | 94,750 | 21.04.2016 | 3.100 | (94) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BOA | 80,000 | 18.02.2019 | 900 | (48) | (6) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BOA | 80,000 | 28.02.2019 | 500 | (27) | (3) | 0,00 |
| | | | | | $ (523) | $ (196) | (0,07) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,730 % | 29.01.2016 | $ 18.000 | $ (26) | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,915 % | 29.01.2016 | 18.000 | (44) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | 4.100 | (16) | (10) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 % | 20.08.2018 | 2.200 | (49) | (39) | (0,01) |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,100 % | 30.01.2018 | 4.200 | (22) | (10) | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,600 % | 30.01.2018 | 4.200 | (38) | (21) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | 14.400 | (59) | (37) | (0,01) |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 12.05.2016 | 18.600 | (63) | (11) | (0,01) |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 23.05.2016 | 43.500 | (136) | (28) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,700 % | 21.08.2017 | 5.100 | (79) | (55) | (0,02) |
| | | | | | | | $ (532) | $ (211) | (0,07) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BRC | $ 3.000 | $ 0 | $ (10) | $ 10 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 1.600 | (17) | (26) | 9 | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 400 | (4) | (7) | 3 | 0,00 |
| Continental AG | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | € 700 | 14 | 2 | 12 | 0,01 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | $ 1.700 | (48) | (31) | (17) | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 2.600 | (82) | (110) | 28 | (0,03) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 1.700 | (48) | (31) | (17) | (0,02) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 400 | (13) | (18) | 5 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | € 600 | (56) | (55) | (1) | (0,02) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | BRC | 1.600 | (10) | (33) | 23 | 0,00 |
| | | | | | $ (264) | $ (319) | $ 55 | (0,09) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 14,830 % | 04.01.2021 | DUB | BRL 13.900 | $ 135 | $ 0 | $ 135 | 0,05 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,800 % | 02.01.2025 | GLM | 12.500 | (251) | 0 | (251) | (0,09) |
| | | | | | | $ (116) | $ 0 | $ (116) | (0,04) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | RAE Fundamental US Large Total Return | 588.837 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 129.167 | 15.04.2016 | BOA | $ 127 | $ 1 | $ 126 | 0,04 |
| Erhalt | RAE Fundamental US Large Total Return | 732.392 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 160.658 | 15.01.2016 | BPS | 157 | 0 | 157 | 0,06 |
| | | | | | | | $ 284 | $ 1 | $ 283 | 0,10 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 3.520 | $ | 913 | BOA | $ 23 | $ 0 | $ 23 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 919 | BRL | 3.520 | BOA | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 4.223 | $ | 1.081 | BPS | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.118 | BRL | 4.223 | BPS | 0 | (51) | (51) | (0,02) |
| 01/2016 | | 5.046 | | 19.364 | BRC | 1 | (152) | (151) | (0,05) |
| 01/2016 | BRL | 19.364 | $ | 4.959 | BRC | 64 | 0 | 64 | 0,02 |
| 01/2016 | | 1.112 | | 285 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 294 | BRL | 1.112 | CBK | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 23.611 | $ | 6.234 | DUB | 266 | 0 | 266 | 0,09 |
| 01/2016 | $ | 6.064 | BRL | 23.611 | DUB | 0 | (96) | (96) | (0,03) |
| 01/2016 | BRL | 3.453 | $ | 884 | GLM | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 885 | BRL | 3.453 | GLM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 162 | | 634 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 634 | $ | 159 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.500 | | 2.965 | JPM | 817 | 0 | 817 | 0,28 |
| 01/2016 | $ | 2.177 | BRL | 8.500 | JPM | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2.667 | | 10.400 | MSB | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 10.400 | $ | 3.617 | MSB | 988 | 0 | 988 | 0,34 |
| 01/2016 | | 590 | | 151 | RYL | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 146 | BRL | 590 | RYL | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 337 | CNH | 2.163 | BPS | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 2.208 | $ | 336 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | CNY | 1.913 | | 292 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 299 | CNY | 1.913 | DUB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.521 | DKK | 79.440 | BOA | 43 | 0 | 43 | 0,01 |
| 01/2016 | DKK | 79.724 | $ | 12.366 | DUB | 761 | 0 | 761 | 0,26 |
| 01/2016 | € | 10.753 | | 11.602 | CBK | 0 | (79) | (79) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 7.993 | € | 7.506 | GLM | 160 | 0 | 160 | 0,05 |
| 01/2016 | € | 34.092 | $ | 36.331 | HUS | 0 | (703) | (703) | (0,24) |
| 01/2016 | $ | 169 | € | 156 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 54 | | 49 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 40.813 | | 37.388 | UAG | 22 | (220) | (198) | (0,07) |
| 01/2016 | € | 205 | $ | 225 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 19.510 | £ | 13.147 | JPM | 0 | (132) | (132) | (0,04) |
| 01/2016 | £ | 13.147 | $ | 19.821 | MSB | 444 | 0 | 444 | 0,15 |
| 01/2016 | INR | 52.298 | | 787 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 836 | INR | 55.270 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 464 | JPY | 57.200 | CBK | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 3.381.126 | $ | 27.609 | GLM | 0 | (498) | (498) | (0,17) |
| 01/2016 | $ | 4.005 | JPY | 490.000 | GLM | 68 | 0 | 68 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY | 138.700 | $ | 1.143 | MSB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 24.050 | JPY | 2.911.926 | MSB | 157 | 0 | 157 | 0,05 |
| 01/2016 | | 1.481 | | 181.000 | UAG | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| 01/2016 | JPY | 120.300 | $ | 980 | UAG | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| 01/2016 | KRW | 63.074 | | 55 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 443.077 | | 379 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 379 | KRW | 443.077 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 538 | | 628.848 | DUB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 492 | | 573.712 | GLM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 823.993 | $ | 719 | GLM | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 153 | KRW | 177.404 | HUS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 571.376 | $ | 502 | HUS | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| 01/2016 | | 443.077 | | 388 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.300.173 | | 1.118 | JPM | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 530 | KRW | 615.225 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 218.991 | $ | 193 | JPM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.209 | KRW | 1.415.053 | UAG | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 2.037 | $ | 472 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.264 | | 1.204 | CBK | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| 01/2016 | | 1.248 | | 292 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 478 | MYR | 2.073 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 372 | | 1.580 | GLM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 1.407 | $ | 328 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.455 | | 333 | JPM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.926 | | 452 | SCX | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 202 | MYR | 862 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 48 | | 207 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 1.131 | | 268 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | MYR | 353 | $ | 83 | UAG | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.176 | | 745 | UAG | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 172 | PHP | 8.044 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 24.717 | $ | 525 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 357 | PHP | 16.840 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 510 | RUB | 33.484 | BRC | 0 | (53) | (53) | (0,02) |
| 01/2016 | RUB | 22.339 | $ | 312 | GLM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | | 47.251 | | 657 | JPM | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 539 | RUB | 36.106 | SOG | 0 | (47) | (47) | (0,02) |
| 01/2016 | THB | 13.003 | $ | 360 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 263 | TRY | 770 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 242 | | 708 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.321 | | 3.865 | GLM | 1 | (4) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 303 | | 885 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 182 | | 534 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | TRY | 6.756 | $ | 2.272 | JPM | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| 01/2016 | TWD | 8.082 | | 246 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 20.207 | | 614 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.757 | | 175 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 1.398 | | 982 | JPM | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 546 | BRL | 2.148 | DUB | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 1.783 | $ | 451 | DUB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 157 | BRL | 634 | HUS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 133 | $ | 96 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 547 | | 412 | JPM | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| 02/2016 | | 131 | | 98 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 115 | | 86 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 811 | CHF | 827 | JPM | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| 02/2016 | CHF | 1.113 | $ | 1.115 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 272 | CHF | 277 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 285 | $ | 42 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 268 | € | 245 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 166 | | 152 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.892 | $ | 2.070 | JPM | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | | 36.613 | | 40.021 | UAG | 220 | 0 | 220 | 0,07 |
| 02/2016 | £ | 13.147 | | 19.511 | JPM | 132 | 0 | 132 | 0,04 |
| 02/2016 | $ | 1.522 | £ | 1.003 | JPM | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| 02/2016 | | 414 | | 279 | MSB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 394 | | 256 | MSB | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| 02/2016 | ILS | 23.805 | $ | 6.138 | BPS | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 555 | ILS | 2.141 | BRC | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | | 232 | | 898 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 445 | | 1.718 | GLM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.988 | | 15.509 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 566 | | 2.190 | SOG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 11.505 | JPY | 1.415.700 | JPM | 274 | 0 | 274 | 0,09 |
| 02/2016 | JPY | 2.911.926 | $ | 24.064 | MSB | 0 | (158) | (158) | (0,05) |
| 02/2016 | MYR | 1.909 | | 445 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | | 508 | | 119 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 534 | SEK | 4.640 | BOA | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| 02/2016 | SEK | 4.640 | $ | 538 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 11 | | 8 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 878 | | 621 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 546 | | 388 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.066 | | 753 | SOG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 19.280 | | 536 | FBF | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.276 | | 229 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.050 | | 29 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 35.085 | | 970 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 241 | THB | 8.673 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 12.280 | $ | 374 | BRC | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 264 | TWD | 8.632 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 8.477 | $ | 259 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 10.642 | | 325 | GLM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.879 | | 180 | UAG | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 5.573 | | 326 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 2.784 | MXN | 48.054 | BRC | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| 03/2016 | | 662 | | 11.446 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 12.421 | $ | 710 | CBK | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 03/2016 | | 102.355 | | 5.968 | GLM | 71 | 0 | 71 | 0,02 |
| 03/2016 | $ | 147 | MXN | 2.547 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 03/2016 | | 104 | | 1.770 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | | 584 | | 10.097 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 3.020 | $ | 177 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 03/2016 | $ | 2.533 | RUB | 180.395 | BOA | 0 | (117) | (117) | (0,04) |
| 03/2016 | | 296 | | 21.840 | GLM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 57.300 | $ | 16.879 | CBK | 2.837 | 0 | 2.837 | 0,96 |
| 04/2016 | $ | 641 | RUB | 47.251 | JPM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 05/2016 | | 433 | MYR | 1.864 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 05/2016 | | 55 | | 233 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 05/2016 | | 248 | | 1.059 | SCX | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 36.800 | $ | 8.927 | DUB | 172 | 0 | 172 | 0,06 |
| 09/2016 | CNH | 4.961 | | 754 | BPS | 18 | 0 | 18 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 09/2016 | CNH 2.321 | $ 353 | SCX | $ 9 | $ 0 | $ 9 | 0,00 |
| 09/2016 | 14.866 | 2.251 | SCX | 49 | 0 | 49 | 0,02 |
| 10/2016 | 6.881 | 1.050 | HUS | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| 12/2016 | 4.638 | 698 | HUS | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| 12/2016 | 8.083 | 1.215 | MSB | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| 01/2017 | BRL 53.800 | 12.507 | BPS | 425 | 0 | 425 | 0,14 |
| | | | | $ 8.413 | $ (2.765) | $ 5.648 | 1,92 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 5.353** | **1,82** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Itau Unibanco S.A.** | | | | |
| 1,695 % fällig am 21.06.2016 | $ | 1.800 | $ 1.801 | 0,61 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **$ 1.801** | **0,61** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 327.200** | **111,25** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 361 | $ 533 | 0,18 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 28 | 28 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 61 | 45 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 92 | 63 | 0,02 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 763 | 763 | 0,26 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 3 | 0 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 4 | 3 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 0 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 4 | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 238 | 238 | 0,08 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 229 | 229 | 0,08 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 36 | 26 | 0,01 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 137 | 98 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 21 | 23 | 0,01 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 114 | 168 | 0,06 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 2.238** | **0,76** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (35.324)** | **(12,01)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 294.114** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.315 und Barmittel in Höhe von USD 338 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(d) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.178 und Barmittel in Höhe von USD 273 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(e) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 670 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(g) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 147 | $ 321.386 | $ 521 | $ 322.054 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.801 | 0 | 1.801 |
| Finanzderivate[3] | (381) | 3.726 | 0 | 3.345 |
| **Summen** | **$ (234)** | **$ 326.913** | **$ 521** | **$ 327.200** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.300 | $ 441.800 | $ 1.369 | $ 445.469 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 8.402 | 0 | 8.402 |
| Finanzderivate[3] | (1.207) | 9.354 | 0 | 8.147 |
| Leerverkäufe | 0 | (23.838) | 0 | (23.838) |
| **Summen** | **$ 1.093** | **$ 435.718** | **$ 1.369** | **$ 438.180** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(h) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 18.454 | € 17.309 | BOA | $ 348 | $ 0 | $ 348 | 0,12 |
| 01/2016 | € 16.840 | $ 18.500 | BOA | 209 | (3) | 206 | 0,07 |
| 01/2016 | 592 | 643 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.401 | 1.508 | CBK | 4 | (17) | (13) | 0,00 |
| 01/2016 | 59 | 63 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 12.511 | € 11.808 | GLM | 316 | 0 | 316 | 0,11 |
| 01/2016 | 18.423 | 17.288 | HUS | 357 | 0 | 357 | 0,12 |
| 01/2016 | € 16.736 | $ 18.392 | HUS | 212 | 0 | 212 | 0,07 |
| 01/2016 | 11.280 | 12.326 | JPM | 73 | 0 | 73 | 0,02 |
| 01/2016 | 86 | 91 | NAB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | 49 | 54 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 43 | 47 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1 | € 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 17.167 | $ 18.743 | UAG | 102 | (8) | 94 | 0,03 |
| 01/2016 | $ 18.339 | € 17.257 | UAG | 407 | 0 | 407 | 0,14 |
| 02/2016 | 18.402 | 16.736 | BOA | 0 | (209) | (209) | (0,07) |
| 02/2016 | € 118 | $ 130 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 18.405 | € 16.736 | HUS | 0 | (212) | (212) | (0,07) |
| 02/2016 | 12.335 | 11.280 | JPM | 0 | (73) | (73) | (0,03) |
| 02/2016 | € 1 | $ 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 17.873 | € 16.351 | UAG | 0 | (98) | (98) | (0,03) |
| | | | | $ 2.029 | $ (623) | $ 1.406 | 0,48 |

**(i) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) and Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 3.467 | $ 3.784 | $ (14) | $ 0 | $ (14) | 0,04 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 255 | $ (1.580) | $ (1.325) |
| BPS | 588 | (2.170) | (1.582) |
| BRC | (234) | 310 | 76 |
| CBK | 2.648 | (2.690) | (42) |
| DUB | 1.203 | (1.570) | (367) |
| FBF | (13) | 0 | (13) |
| GLM | (40) | (180) | (220) |
| GST | (4) | 0 | (4) |
| HUS | (372) | 360 | (12) |
| JPM | 1.014 | (1.110) | (96) |
| MSB | 1.387 | (1.270) | 117 |
| MYC | (12) | 0 | (12) |
| NAB | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 5 | 0 | 5 |
| SCX | 52 | 0 | 52 |
| SOG | (58) | 0 | (58) |
| UAG | 450 | (400) | 50 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(k) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 109,50 | 103,81 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,22) | (0,28) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,46) | (0,71) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,82 | 2,89 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (5,56) |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,61 | 1,96 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 6.590.016 | $ 65.949 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | $ | 29.151 | 29.394 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.04.2016 | BRL | 57.300 | 16.575 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 12.306 | 15.539 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 13.155 | 13.028 |
| **Realkredit Danmark** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 77.700 | 12.135 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 53.800 | 12.055 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2015 | MXN | 1.616.000 | 11.196 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.08.2028 | $ | 8.100 | 10.919 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 7.500 | 9.524 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | $ | 9.515 | 9.366 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 36.800 | 8.814 |
| **Sweden Government Bond** | | | |
| 2,500 % fällig am 12.05.2025 | SEK | 61.200 | 8.712 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2015 | $ | 7.800 | 7.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,113 % fällig am 13.03.2015 | | 7.700 | 7.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2015 | | 7.700 | 7.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 7.500 | 7.498 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 23.100 | 7.285 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 5.100 | 7.156 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | $ | 7.100 | 7.099 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2015 | | 7.100 | 7.098 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 09.10.2015 | | 7.000 | 6.999 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2015 | | 6.600 | 6.598 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2016 | BRL | 18.900 | 6.438 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 4.300 | 5.955 |
| **Wyndham Worldwide Corp.** | | | |
| 0,000 % fällig am 26.05.2015 | $ | 5.900 | 5.897 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 03.06.2015 | | 5.700 | 5.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 02.09.2015 | | 5.400 | 5.399 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,085 % fällig am 06.07.2015 | | 5.400 | 5.399 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.09.2015 | | 5.400 | 5.399 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 6.805.126 | $ 68.100 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,055 % fällig am 16.03.2015 | $ | 26.300 | 26.297 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,095 % fällig am 01.05.2015 | | 20.600 | 20.598 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 61.200 | 18.498 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,095 % fällig am 16.04.2015 | $ | 16.200 | 16.198 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 3,640 % fällig am 05.02.2015 | MXN | 2.000.000 | 13.482 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 13.128 | 13.028 |
| **Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A.** | | | |
| 1,125 % fällig am 22.04.2019 | € | 10.800 | 12.908 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | | 9.300 | 12.780 |
| **Spain Government Bond** | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 9.000 | 11.636 |
| **Realkredit Danmark** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 77.700 | 11.463 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2015 | BRL | 35.700 | 11.344 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.08.2028 | $ | 8.100 | 10.923 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2015 | MXN | 1.616.000 | 10.554 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | $ | 9.009 | 8.852 |
| **Sweden Government Bond** | | | |
| 2,500 % fällig am 12.05.2025 | SEK | 61.200 | 8.536 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,113 % fällig am 13.03.2015 | $ | 8.400 | 8.400 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2015 | | 7.800 | 7.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2015 | | 7.700 | 7.699 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 6.124 | 7.674 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | | 7.100 | 7.099 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.11.2015 | | 7.100 | 7.098 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 09.10.2015 | | 7.000 | 6.999 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 19.600 | 6.799 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2015 | $ | 6.600 | 6.598 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,375 % fällig am 10.07.2017 | € | 5.900 | 6.437 |
| **Depfa ACS Bank** | | | |
| 3,875 % fällig am 14.11.2016 | | 5.520 | 6.336 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 4.300 | 6.056 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2023 | | 4.000 | 5.789 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 17.900 | 5.716 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 03.06.2015 | $ | 5.700 | 5.699 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 5.600 | 5.598 |

(a) Der PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **IRLAND** | | | |
| Accenture PLC | 371 | $ 39 | 0,30 |
| XL Group PLC | 135 | 5 | 0,04 |
| | | 44 | 0,34 |
| **PERU** | | | |
| Southern Copper Corp. | 181 | 5 | 0,04 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| ACE Ltd. | 40 | 4 | 0,03 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aaron's, Inc. | 364 | 8 | 0,06 |
| Abercrombie & Fitch Co. | 766 | 21 | 0,16 |
| Advance Auto Parts, Inc. | 16 | 2 | 0,02 |
| Amazon.com, Inc. | 150 | 101 | 0,79 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 727 | 11 | 0,09 |
| Apollo Education Group, Inc. | 750 | 6 | 0,05 |
| Ascena Retail Group, Inc. | 70 | 1 | 0,01 |
| AutoNation, Inc. | 83 | 5 | 0,04 |
| AutoZone, Inc. | 7 | 5 | 0,04 |
| Barnes & Noble, Inc. | 263 | 2 | 0,02 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 635 | 31 | 0,24 |
| Best Buy Co., Inc. | 867 | 26 | 0,21 |
| Big Lots, Inc. | 480 | 19 | 0,14 |
| Bloomin' Brands, Inc. | 527 | 9 | 0,07 |
| Bob Evans Farms, Inc. | 126 | 5 | 0,04 |
| Boyd Gaming Corp. | 276 | 6 | 0,04 |
| Brinker International, Inc. | 124 | 6 | 0,05 |
| Burlington Stores, Inc. | 242 | 10 | 0,08 |
| Cablevision Systems Corp. | 771 | 25 | 0,19 |
| Carnival Corp. | 490 | 27 | 0,21 |
| CBS Corp. | 358 | 17 | 0,13 |
| Charter Communications, Inc. | 15 | 3 | 0,02 |
| Chico's FAS, Inc. | 863 | 9 | 0,07 |
| Chipotle Mexican Grill, Inc. | 6 | 3 | 0,02 |
| Cinemark Holdings, Inc. | 125 | 4 | 0,03 |
| Coach, Inc. | 1.014 | 33 | 0,26 |
| Comcast Corp. | 1.310 | 74 | 0,57 |
| Cracker Barrel Old Country Store, Inc. | 34 | 4 | 0,03 |
| CST Brands, Inc. | 99 | 4 | 0,03 |
| Dana Holding Corp. | 459 | 6 | 0,05 |
| DeVry Education Group, Inc. | 165 | 4 | 0,03 |
| Dillard's, Inc. | 153 | 10 | 0,08 |
| Discovery Communications, Inc. | 160 | 4 | 0,03 |
| Dollar General Corp. | 153 | 11 | 0,09 |
| Dollar Tree, Inc. | 173 | 13 | 0,10 |
| Expedia, Inc. | 96 | 12 | 0,09 |
| Express, Inc. | 292 | 5 | 0,04 |
| Foot Locker, Inc. | 85 | 6 | 0,04 |
| Ford Motor Co. | 444 | 6 | 0,05 |
| Fossil Group, Inc. | 201 | 7 | 0,06 |
| GameStop Corp. | 605 | 17 | 0,13 |
| Gap, Inc. | 1.029 | 26 | 0,20 |
| Genesco, Inc. | 89 | 5 | 0,04 |
| Genuine Parts Co. | 34 | 3 | 0,02 |
| GNC Holdings, Inc. | 108 | 3 | 0,03 |
| Goodyear Tire & Rubber Co. | 98 | 3 | 0,03 |
| Graham Holdings Co. | 13 | 6 | 0,05 |
| Guess?, Inc. | 433 | 8 | 0,06 |
| Hanesbrands, Inc. | 150 | 5 | 0,03 |
| Hasbro, Inc. | 243 | 16 | 0,13 |
| Hilton Worldwide Holdings, Inc. | 183 | $ 4 | 0,03 |
| Home Depot, Inc. | 977 | 129 | 1,00 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 1.046 | 24 | 0,19 |
| Kohl's Corp. | 985 | 47 | 0,37 |
| L Brands, Inc. | 283 | 27 | 0,21 |
| Leggett & Platt, Inc. | 103 | 4 | 0,03 |
| Liberty Interactive Corporation QVC Group | 781 | 21 | 0,17 |
| Lowe's Cos., Inc. | 1.197 | 91 | 0,71 |
| Macy's, Inc. | 484 | 17 | 0,13 |
| Marriott International, Inc. | 68 | 5 | 0,04 |
| Mattel, Inc. | 922 | 25 | 0,20 |
| McDonald's Corp. | 914 | 108 | 0,84 |
| Molson Coors Brewing Co. | 55 | 5 | 0,04 |
| Murphy USA, Inc. | 91 | 6 | 0,04 |
| NIKE, Inc. | 870 | 54 | 0,42 |
| Nordstrom, Inc. | 121 | 6 | 0,05 |
| Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. | 86 | 5 | 0,04 |
| Omnicom Group, Inc. | 466 | 35 | 0,27 |
| O'Reilly Automotive, Inc. | 76 | 19 | 0,15 |
| Outerwall, Inc. | 66 | 2 | 0,02 |
| Ralph Lauren Corp. | 130 | 15 | 0,11 |
| Regal Entertainment Group | 626 | 12 | 0,09 |
| Rent-A-Center, Inc. | 767 | 12 | 0,09 |
| Ross Stores, Inc. | 220 | 12 | 0,09 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | 140 | 14 | 0,11 |
| Sally Beauty Holdings, Inc. | 178 | 5 | 0,04 |
| Sears Holdings Corp. | 185 | 4 | 0,03 |
| SeaWorld Entertainment, Inc. | 731 | 14 | 0,11 |
| Staples, Inc. | 3.008 | 29 | 0,22 |
| Starbucks Corp. | 279 | 17 | 0,13 |
| Target Corp. | 1.298 | 94 | 0,73 |
| Tenneco, Inc. | 87 | 4 | 0,03 |
| Time Warner Cable, Inc. | 508 | 94 | 0,73 |
| Time Warner, Inc. | 1.209 | 78 | 0,61 |
| Time, Inc. | 895 | 14 | 0,11 |
| TJX Cos., Inc. | 239 | 17 | 0,13 |
| Tractor Supply Co. | 72 | 6 | 0,05 |
| Tribune Media Co. | 269 | 9 | 0,07 |
| Tupperware Brands Corp. | 189 | 11 | 0,08 |
| Urban Outfitters, Inc. | 144 | 3 | 0,03 |
| VF Corp. | 85 | 5 | 0,04 |
| Viacom, Inc. | 899 | 37 | 0,29 |
| Walt Disney Co. | 613 | 65 | 0,50 |
| Weight Watchers International, Inc. | 864 | 20 | 0,15 |
| Wendy's Co. | 599 | 7 | 0,05 |
| Whirlpool Corp. | 29 | 4 | 0,03 |
| Wyndham Worldwide Corp. | 201 | 15 | 0,11 |
| Wynn Resorts Ltd. | 139 | 10 | 0,08 |
| Yum! Brands, Inc. | 217 | 16 | 0,12 |
| | | 1.930 | 15,00 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 1.108 | 65 | 0,50 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 128 | 5 | 0,04 |
| Avon Products, Inc. | 3.480 | 14 | 0,11 |
| Bunge Ltd. | 212 | 14 | 0,11 |
| Campbell Soup Co. | 58 | 3 | 0,02 |
| Casey's General Stores, Inc. | 48 | 6 | 0,05 |
| Coca-Cola Co. | 1.848 | 79 | 0,62 |
| Coca-Cola Enterprises, Inc. | 360 | 18 | 0,14 |
| Colgate-Palmolive Co. | 348 | 23 | 0,18 |
| ConAgra Foods, Inc. | 498 | 21 | 0,16 |
| Costco Wholesale Corp. | 169 | 27 | 0,21 |
| CVS Health Corp. | 669 | 65 | 0,51 |
| Dr. Pepper Snapple Group, Inc. | 310 | 29 | 0,22 |
| Estee Lauder Cos., Inc. | 58 | $ 5 | 0,04 |
| General Mills, Inc. | 444 | 26 | 0,20 |
| Herbalife Ltd. | 438 | 23 | 0,18 |
| JM Smucker Co. | 118 | 15 | 0,11 |
| Kellogg Co. | 219 | 16 | 0,12 |
| Kimberly-Clark Corp. | 31 | 4 | 0,03 |
| Kraft Heinz Co. | 147 | 11 | 0,08 |
| Kroger Co. | 1.685 | 70 | 0,55 |
| Mondelez International, Inc. | 1.108 | 50 | 0,39 |
| Monster Beverage Corp. | 32 | 5 | 0,04 |
| Nu Skin Enterprises, Inc. | 111 | 4 | 0,03 |
| PepsiCo, Inc. | 962 | 96 | 0,75 |
| Philip Morris International, Inc. | 1.559 | 137 | 1,07 |
| Procter & Gamble Co. | 1.687 | 134 | 1,04 |
| Reynolds American, Inc. | 594 | 27 | 0,21 |
| Rite Aid Corp. | 2.358 | 18 | 0,14 |
| SUPERVALU, Inc. | 609 | 4 | 0,03 |
| Sysco Corp. | 503 | 21 | 0,16 |
| Universal Corp. | 107 | 6 | 0,05 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 506 | 43 | 0,34 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 2.277 | 140 | 1,08 |
| Whole Foods Market, Inc. | 151 | 5 | 0,04 |
| | | 1.229 | 9,55 |
| **ENERGY** | | | |
| Anadarko Petroleum Corp. | 78 | 4 | 0,03 |
| Apache Corp. | 212 | 9 | 0,07 |
| Baker Hughes, Inc. | 153 | 7 | 0,05 |
| Bill Barrett Corp. | 1.380 | 5 | 0,04 |
| California Resources Corp. | 3.351 | 8 | 0,06 |
| Cameron International Corp. | 271 | 17 | 0,13 |
| Chesapeake Energy Corp. | 3.518 | 16 | 0,12 |
| Chevron Corp. | 3.092 | 278 | 2,16 |
| ConocoPhillips | 2.979 | 139 | 1,08 |
| Devon Energy Corp. | 422 | 13 | 0,11 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. | 224 | 5 | 0,04 |
| Energen Corp. | 212 | 9 | 0,07 |
| EOG Resources, Inc. | 89 | 6 | 0,05 |
| Exxon Mobil Corp. | 4.645 | 362 | 2,81 |
| Halliburton Co. | 469 | 16 | 0,12 |
| Hess Corp. | 370 | 18 | 0,14 |
| HollyFrontier Corp. | 454 | 18 | 0,14 |
| Kinder Morgan, Inc. | 130 | 2 | 0,02 |
| Marathon Oil Corp. | 2.315 | 29 | 0,23 |
| Marathon Petroleum Corp. | 517 | 27 | 0,21 |
| Murphy Oil Corp. | 805 | 18 | 0,14 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 527 | 18 | 0,14 |
| Newfield Exploration Co. | 256 | 8 | 0,06 |
| Occidental Petroleum Corp. | 610 | 41 | 0,32 |
| Patterson-UTI Energy, Inc. | 300 | 4 | 0,04 |
| Peabody Energy Corp. | 132 | 1 | 0,01 |
| Phillips 66 | 130 | 11 | 0,08 |
| Rowan Cos PLC | 242 | 4 | 0,03 |
| Schlumberger Ltd. | 370 | 26 | 0,20 |
| SEACOR Holdings, Inc. | 70 | 4 | 0,03 |
| Spectra Energy Corp. | 155 | 4 | 0,03 |
| Stone Energy Corp. | 1.187 | 5 | 0,04 |
| Tesoro Corp. | 102 | 11 | 0,08 |
| Tidewater, Inc. | 219 | 2 | 0,01 |
| Unit Corp. | 183 | 2 | 0,02 |
| Valero Energy Corp. | 303 | 21 | 0,17 |
| Whiting Petroleum Corp. | 489 | 5 | 0,04 |
| WPX Energy, Inc. | 665 | 4 | 0,03 |
| | | 1.177 | 9,15 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Allstate Corp. | 376 | 23 | 0,18 |
| Ally Financial, Inc. | 301 | 6 | 0,04 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des PIMCO RAE Fundamental US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| American Equity Investment Life Holding Co. | 202 | $ 5 | 0,04 |
| American Express Co. | 295 | 21 | 0,16 |
| American Financial Group, Inc. | 79 | 6 | 0,04 |
| American International Group, Inc. | 1.772 | 110 | 0,85 |
| Assurant, Inc. | 128 | 10 | 0,08 |
| BB&T Corp. | 642 | 24 | 0,19 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 136 | 18 | 0,14 |
| BGC Partners, Inc. | 534 | 5 | 0,04 |
| Capital One Financial Corp. | 717 | 52 | 0,40 |
| Chubb Corp. | 345 | 46 | 0,36 |
| CIT Group, Inc. | 263 | 10 | 0,08 |
| Citigroup, Inc. | 2.535 | 131 | 1,02 |
| Citizens Financial Group, Inc. | 817 | 21 | 0,17 |
| CME Group, Inc. | 444 | 40 | 0,31 |
| Columbia Property Trust, Inc. | 202 | 5 | 0,04 |
| Discover Financial Services | 140 | 8 | 0,06 |
| E*TRADE Financial Corp. | 534 | 16 | 0,12 |
| Fifth Third Bancorp | 1.707 | 34 | 0,27 |
| First Horizon National Corp. | 1.100 | 16 | 0,12 |
| First Niagara Financial Group, Inc. | 1.120 | 12 | 0,09 |
| Great Western Bancorp, Inc. | 165 | 5 | 0,04 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. | 369 | 16 | 0,12 |
| JPMorgan Chase & Co. | 4.162 | 275 | 2,14 |
| Legg Mason, Inc. | 602 | 24 | 0,18 |
| Loews Corp. | 347 | 13 | 0,10 |
| McGraw Hill Financial, Inc. | 115 | 11 | 0,09 |
| MetLife, Inc. | 231 | 11 | 0,09 |
| Nasdaq, Inc. | 305 | 18 | 0,14 |
| New Residential Investment Corp. | 326 | 4 | 0,03 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 703 | 12 | 0,09 |
| OneMain Holdings, Inc. | 112 | 5 | 0,04 |
| Outfront Media, Inc. | 194 | 4 | 0,03 |
| People's United Financial, Inc. | 834 | 14 | 0,11 |
| PHH Corp. | 399 | 6 | 0,05 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 498 | 47 | 0,37 |
| Primerica, Inc. | 109 | 5 | 0,04 |
| Progressive Corp. | 97 | 3 | 0,02 |
| Regions Financial Corp. | 1.982 | 19 | 0,15 |
| Reinsurance Group of America, Inc. | 129 | 11 | 0,09 |
| Santander Consumer USA Holdings, Inc. | 423 | 7 | 0,05 |
| SLM Corp. | 1.881 | 12 | 0,10 |
| StanCorp Financial Group, Inc. | 44 | 5 | 0,04 |
| SunTrust Banks, Inc. | 491 | 21 | 0,16 |
| Synchrony Financial | 365 | 11 | 0,09 |
| Travelers Cos., Inc. | 888 | 100 | 0,78 |
| Trustmark Corp. | 197 | 5 | 0,04 |
| Unum Group | 267 | 9 | 0,07 |
| US Bancorp | 185 | 8 | 0,06 |
| Valley National Bancorp | 450 | 4 | 0,03 |
| Voya Financial, Inc. | 450 | 17 | 0,13 |
| Wells Fargo & Co. | 2.305 | 125 | 0,97 |
| WR Berkley Corp. | 98 | 5 | 0,04 |
| | | 1.451 | 11,28 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 705 | 32 | 0,25 |
| AbbVie, Inc. | 720 | 43 | 0,33 |
| Aetna, Inc. | 438 | 47 | 0,37 |
| Alere, Inc. | 96 | 4 | 0,03 |
| Alexion Pharmaceuticals, Inc. | 28 | 5 | 0,04 |
| AmerisourceBergen Corp. | 130 | 14 | 0,11 |
| Amgen, Inc. | 545 | 88 | 0,69 |
| Anthem, Inc. | 641 | 89 | 0,69 |
| Baxter International, Inc. | 524 | $ 20 | 0,16 |
| Becton Dickinson & Co. | 179 | 28 | 0,21 |
| Biogen, Inc. | 87 | 27 | 0,21 |
| Bio-Rad Laboratories, Inc. | 43 | 6 | 0,05 |
| Boston Scientific Corp. | 1.038 | 19 | 0,15 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 960 | 66 | 0,51 |
| Cardinal Health, Inc. | 132 | 12 | 0,09 |
| Celgene Corp. | 363 | 43 | 0,34 |
| Centene Corp. | 63 | 4 | 0,03 |
| Charles River Laboratories International, Inc. | 38 | 3 | 0,02 |
| Cigna Corp. | 91 | 13 | 0,10 |
| Community Health Systems, Inc. | 604 | 16 | 0,12 |
| CR Bard, Inc. | 74 | 14 | 0,11 |
| DaVita HealthCare Partners, Inc. | 63 | 4 | 0,03 |
| Edwards Lifesciences Corp. | 94 | 7 | 0,06 |
| Eli Lilly & Co. | 806 | 68 | 0,53 |
| Envision Healthcare Holdings, Inc. | 127 | 3 | 0,03 |
| Express Scripts Holding Co. | 281 | 25 | 0,19 |
| Gilead Sciences, Inc. | 523 | 53 | 0,41 |
| Halyard Health, Inc. | 123 | 4 | 0,03 |
| HCA Holdings, Inc. | 976 | 66 | 0,51 |
| Health Net, Inc. | 178 | 12 | 0,09 |
| Henry Schein, Inc. | 42 | 7 | 0,05 |
| Hologic, Inc. | 164 | 6 | 0,05 |
| Humana, Inc. | 156 | 28 | 0,22 |
| Illumina, Inc. | 25 | 5 | 0,04 |
| Johnson & Johnson | 1.295 | 133 | 1,03 |
| Kindred Healthcare, Inc. | 324 | 4 | 0,03 |
| LifePoint Health, Inc. | 109 | 8 | 0,06 |
| Magellan Health, Inc. | 89 | 6 | 0,04 |
| Mallinckrodt PLC | 59 | 4 | 0,03 |
| McKesson Corp. | 114 | 23 | 0,18 |
| Merck & Co., Inc. | 1.460 | 77 | 0,60 |
| Mettler-Toledo International, Inc. | 15 | 5 | 0,04 |
| Mylan NV | 74 | 4 | 0,03 |
| Owens & Minor, Inc. | 147 | 5 | 0,04 |
| Patterson Cos., Inc. | 104 | 5 | 0,04 |
| Pfizer, Inc. | 5.171 | 167 | 1,30 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 510 | 36 | 0,28 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. | 21 | 11 | 0,09 |
| St Jude Medical, Inc. | 230 | 14 | 0,11 |
| Stryker Corp. | 99 | 9 | 0,07 |
| Tenet Healthcare Corp. | 151 | 5 | 0,04 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | 39 | 6 | 0,04 |
| United Therapeutics Corp. | 29 | 5 | 0,04 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 773 | 91 | 0,71 |
| Universal Health Services, Inc. | 91 | 11 | 0,08 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. | 21 | 2 | 0,02 |
| VCA, Inc. | 93 | 5 | 0,04 |
| WellCare Health Plans, Inc. | 74 | 6 | 0,05 |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc. | 156 | 16 | 0,12 |
| Zoetis, Inc. | 253 | 12 | 0,09 |
| | | 1.551 | 12,05 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 375 | 57 | 0,44 |
| ADT Corp. | 708 | 23 | 0,18 |
| AGCO Corp. | 147 | 7 | 0,05 |
| Alaska Air Group, Inc. | 122 | 10 | 0,08 |
| Armstrong World Industries, Inc. | 339 | 16 | 0,12 |
| Avis Budget Group, Inc. | 203 | 7 | 0,06 |
| Caterpillar, Inc. | 517 | 35 | 0,27 |
| CH Robinson Worldwide, Inc. | 44 | 3 | 0,02 |
| Cintas Corp. | 70 | 6 | 0,05 |
| CSX Corp. | 1.041 | 27 | 0,21 |
| Cummins, Inc. | 38 | 3 | 0,03 |
| Danaher Corp. | 233 | $ 22 | 0,17 |
| Deere & Co. | 629 | 48 | 0,37 |
| Delta Air Lines, Inc. | 64 | 3 | 0,02 |
| Dover Corp. | 175 | 11 | 0,08 |
| Dun & Bradstreet Corp. | 119 | 12 | 0,10 |
| Emerson Electric Co. | 690 | 33 | 0,26 |
| Equifax, Inc. | 57 | 6 | 0,05 |
| FedEx Corp. | 30 | 4 | 0,03 |
| Fluor Corp. | 94 | 4 | 0,03 |
| GATX Corp. | 92 | 4 | 0,03 |
| General Electric Co. | 4.596 | 143 | 1,11 |
| Harsco Corp. | 471 | 4 | 0,03 |
| HD Supply Holdings, Inc. | 144 | 4 | 0,03 |
| Hertz Global Holdings, Inc. | 703 | 10 | 0,08 |
| Honeywell International, Inc. | 337 | 35 | 0,27 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 275 | 26 | 0,20 |
| Ingersoll-Rand PLC | 245 | 14 | 0,11 |
| Jacobs Engineering Group, Inc. | 123 | 5 | 0,04 |
| JetBlue Airways Corp. | 993 | 23 | 0,17 |
| KBR, Inc. | 728 | 12 | 0,10 |
| Kennametal, Inc. | 146 | 3 | 0,02 |
| KLX, Inc. | 441 | 14 | 0,11 |
| L-3 Communications Holdings, Inc. | 146 | 17 | 0,14 |
| ManpowerGroup, Inc. | 58 | 5 | 0,04 |
| Norfolk Southern Corp. | 277 | 23 | 0,18 |
| Northrop Grumman Corp. | 378 | 71 | 0,55 |
| Owens Corning | 133 | 6 | 0,05 |
| PACCAR, Inc. | 92 | 4 | 0,03 |
| Parker-Hannifin Corp. | 168 | 16 | 0,13 |
| Pitney Bowes, Inc. | 585 | 12 | 0,09 |
| Raytheon Co. | 390 | 49 | 0,38 |
| Republic Services, Inc. | 353 | 16 | 0,12 |
| Rockwell Collins, Inc. | 178 | 16 | 0,13 |
| RR Donnelley & Sons Co. | 610 | 9 | 0,07 |
| Ryder System, Inc. | 81 | 5 | 0,04 |
| Southwest Airlines Co. | 105 | 5 | 0,03 |
| SPX Corp. | 83 | 1 | 0,01 |
| Timken Co. | 228 | 7 | 0,05 |
| Towers Watson & Co. | 36 | 5 | 0,04 |
| TransDigm Group, Inc. | 71 | 16 | 0,13 |
| Union Pacific Corp. | 315 | 25 | 0,19 |
| United Continental Holdings, Inc. | 127 | 7 | 0,06 |
| United Parcel Service, Inc. | 47 | 5 | 0,03 |
| United Technologies Corp. | 473 | 45 | 0,35 |
| Waste Management, Inc. | 528 | 28 | 0,22 |
| WESCO International, Inc. | 125 | 5 | 0,04 |
| | | 1.032 | 8,02 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Activision Blizzard, Inc. | 1.376 | 53 | 0,41 |
| Alphabet, Inc. | 221 | 168 | 1,30 |
| Amdocs Ltd. | 150 | 8 | 0,06 |
| Apple, Inc. | 2.767 | 291 | 2,26 |
| Applied Materials, Inc. | 256 | 5 | 0,04 |
| Arrow Electronics, Inc. | 258 | 14 | 0,11 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 175 | 15 | 0,11 |
| Avnet, Inc. | 557 | 24 | 0,19 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 465 | 14 | 0,11 |
| Broadcom Corp. | 289 | 17 | 0,13 |
| Broadridge Financial Solutions, Inc. | 53 | 3 | 0,02 |
| Brocade Communications Systems, Inc. | 548 | 5 | 0,04 |
| CA, Inc. | 868 | 25 | 0,19 |
| CACI International, Inc. | 117 | 11 | 0,08 |
| Cisco Systems, Inc. | 5.683 | 154 | 1,20 |
| Citrix Systems, Inc. | 65 | 5 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| Cognizant Technology Solutions Corp. | 262 | $ 16 | 0,12 |
| Computer Sciences Corp. | 87 | 3 | 0,02 |
| Convergys Corp. | 252 | 6 | 0,05 |
| CoreLogic, Inc. | 127 | 4 | 0,03 |
| Corning, Inc. | 1.742 | 32 | 0,25 |
| CSRA, Inc. | 87 | 3 | 0,02 |
| Diebold, Inc. | 110 | 3 | 0,03 |
| DST Systems, Inc. | 41 | 5 | 0,04 |
| eBay, Inc. | 432 | 12 | 0,09 |
| Electronic Arts, Inc. | 209 | 14 | 0,11 |
| EMC Corp. | 1.821 | 47 | 0,36 |
| Facebook, Inc. | 180 | 19 | 0,15 |
| Fairchild Semiconductor International, Inc. | 159 | 3 | 0,03 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | 168 | 10 | 0,08 |
| Fiserv, Inc. | 136 | 12 | 0,10 |
| Flextronics International Ltd. | 961 | 11 | 0,08 |
| Global Payments, Inc. | 98 | 6 | 0,05 |
| Harris Corp. | 165 | 14 | 0,11 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 6.158 | 94 | 0,73 |
| HP, Inc. | 5.400 | 64 | 0,50 |
| Ingram Micro, Inc. | 362 | 11 | 0,09 |
| Intel Corp. | 6.850 | 236 | 1,83 |
| Inter Active Corp. | 238 | 14 | 0,11 |
| International Business Machines Corp. | 2.083 | 287 | 2,23 |
| Intuit, Inc. | 132 | 13 | 0,10 |
| Jabil Circuit, Inc. | 664 | 15 | 0,12 |
| Juniper Networks, Inc. | 956 | 26 | 0,20 |
| Keysight Technologies, Inc. | 159 | 5 | 0,03 |
| KLA-Tencor Corp. | 107 | 7 | 0,06 |
| Knowles Corp. | 272 | 4 | 0,03 |
| Lam Research Corp. | 62 | 5 | 0,04 |
| Leidos Holdings, Inc. | 235 | 13 | 0,10 |
| Lexmark International, Inc. | 419 | 14 | 0,11 |
| MasterCard, Inc. | 436 | 42 | 0,33 |
| Maxim Integrated Products, Inc. | 423 | 16 | 0,12 |
| Microsoft Corp. | 4.852 | 269 | 2,09 |
| Motorola Solutions, Inc. | 474 | 32 | 0,25 |
| NCR Corp. | 239 | 6 | 0,05 |
| NetApp, Inc. | 492 | 13 | 0,10 |
| NeuStar, Inc. | 515 | 12 | 0,10 |
| NVIDIA Corp. | 125 | 4 | 0,03 |
| Oracle Corp. | 2.449 | 89 | 0,69 |
| Paychex, Inc. | 107 | 6 | 0,04 |
| Polycom, Inc. | 812 | 10 | 0,08 |
| QUALCOMM, Inc. | 459 | 23 | 0,18 |
| Red Hat, Inc. | 66 | 6 | 0,04 |
| SanDisk Corp. | 83 | 6 | 0,05 |
| Seagate Technology PLC | 625 | 23 | 0,18 |
| Skyworks Solutions, Inc. | 49 | 4 | 0,03 |
| Symantec Corp. | 1.509 | 32 | 0,25 |
| Synopsys, Inc. | 100 | 5 | 0,04 |
| Take-Two Interactive Software, Inc. | 179 | 6 | 0,05 |
| Tech Data Corp. | 158 | $ 11 | 0,08 |
| Teradata Corp. | 321 | 9 | 0,07 |
| Teradyne, Inc. | 260 | 5 | 0,04 |
| Texas Instruments, Inc. | 661 | 36 | 0,28 |
| Visa, Inc. | 1.039 | 81 | 0,63 |
| Vishay Intertechnology, Inc. | 494 | 6 | 0,05 |
| Western Digital Corp. | 61 | 4 | 0,03 |
| Western Union Co. | 1.728 | 31 | 0,24 |
| Xerox Corp. | 1.986 | 21 | 0,16 |
| Yahoo!, Inc. | 128 | 4 | 0,03 |
| | | 2.652 | 20,60 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Products & Chemicals, Inc. | 76 | 10 | 0,08 |
| Airgas, Inc. | 94 | 13 | 0,10 |
| Alcoa, Inc. | 544 | 5 | 0,04 |
| Ashland, Inc. | 41 | 4 | 0,03 |
| Ball Corp. | 99 | 7 | 0,06 |
| Bemis Co., Inc. | 110 | 5 | 0,04 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 237 | 10 | 0,08 |
| Commercial Metals Co. | 329 | 4 | 0,03 |
| Dow Chemical Co. | 553 | 28 | 0,22 |
| El du Pont de Nemours & Co. | 410 | 27 | 0,21 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 959 | 6 | 0,05 |
| LyondellBasell Industries NV | 179 | 16 | 0,12 |
| Monsanto Co. | 191 | 19 | 0,15 |
| Mosaic Co. | 357 | 10 | 0,08 |
| Newmont Mining Corp. | 1.151 | 21 | 0,16 |
| Owens-Illinois, Inc. | 297 | 5 | 0,04 |
| PPG Industries, Inc. | 57 | 6 | 0,04 |
| Praxair, Inc. | 66 | 7 | 0,05 |
| Sherwin-Williams Co. | 41 | 11 | 0,08 |
| | | 214 | 1,66 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 11.631 | 400 | 3,11 |
| CenturyLink, Inc. | 2.155 | 54 | 0,42 |
| Frontier Communications Corp. | 6.723 | 32 | 0,24 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 252 | 7 | 0,05 |
| T-Mobile US, Inc. | 135 | 5 | 0,04 |
| Verizon Communications, Inc. | 3.706 | 171 | 1,33 |
| Windstream Holdings, Inc. | 2.509 | 16 | 0,13 |
| | | 685 | 5,32 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 569 | 5 | 0,04 |
| AGL Resources, Inc. | 61 | 4 | 0,03 |
| Ameren Corp. | 639 | 28 | 0,22 |
| American Electric Power Co., Inc. | 609 | 35 | 0,28 |
| American Water Works Co., Inc. | 55 | 3 | 0,03 |
| Atmos Energy Corp. | 66 | 4 | 0,03 |
| Avista Corp. | 168 | 6 | 0,05 |
| Calpine Corp. | 1.153 | 17 | 0,13 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 935 | 17 | 0,13 |
| CMS Energy Corp. | 352 | 13 | 0,10 |
| Consolidated Edison, Inc. | 793 | $ 51 | 0,40 |
| Dominion Resources, Inc. | 183 | 12 | 0,10 |
| DTE Energy Co. | 328 | 26 | 0,20 |
| Duke Energy Corp. | 684 | 49 | 0,38 |
| Edison International | 421 | 25 | 0,19 |
| Entergy Corp. | 661 | 45 | 0,35 |
| Exelon Corp. | 1.406 | 39 | 0,30 |
| FirstEnergy Corp. | 888 | 28 | 0,22 |
| Great Plains Energy, Inc. | 205 | 6 | 0,04 |
| MDU Resources Group, Inc. | 698 | 13 | 0,10 |
| NextEra Energy, Inc. | 243 | 25 | 0,20 |
| NiSource, Inc. | 273 | 5 | 0,04 |
| ONE Gas, Inc. | 118 | 6 | 0,05 |
| Pepco Holdings, Inc. | 505 | 13 | 0,10 |
| PG&E Corp. | 621 | 33 | 0,26 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 266 | 17 | 0,13 |
| PNM Resources, Inc. | 249 | 8 | 0,06 |
| Portland General Electric Co. | 154 | 6 | 0,04 |
| PPL Corp. | 606 | 21 | 0,16 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 871 | 34 | 0,26 |
| SCANA Corp. | 122 | 7 | 0,06 |
| Sempra Energy | 124 | 12 | 0,09 |
| Southern Co. | 1.030 | 48 | 0,37 |
| TECO Energy, Inc. | 783 | 21 | 0,16 |
| UGI Corp. | 144 | 5 | 0,04 |
| Vectren Corp. | 152 | 6 | 0,05 |
| WEC Energy Group, Inc. | 104 | 5 | 0,04 |
| Westar Energy, Inc. | 182 | 8 | 0,06 |
| WGL Holdings, Inc. | 91 | 6 | 0,04 |
| Xcel Energy, Inc. | 605 | 22 | 0,17 |
| | | 734 | 5,70 |
| Summe USA | | 12.655 | 98,33 |
| Summe Stammaktien | | 12.708 | 98,74 |
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| American Capital Agency Corp. | 637 | 11 | 0,09 |
| Annaly Capital Management, Inc. | 3.697 | 35 | 0,27 |
| Corrections Corporation of America | 149 | 4 | 0,03 |
| Hatteras Financial Corp. | 302 | 4 | 0,03 |
| Iron Mountain, Inc. | 622 | 17 | 0,13 |
| Mack-Cali Realty Corp. | 213 | 5 | 0,04 |
| MFA Financial, Inc. | 695 | 4 | 0,04 |
| Piedmont Office Realty Trust, Inc. | 424 | 8 | 0,06 |
| Simon Property Group, Inc. | 29 | 6 | 0,04 |
| Weyerhaeuser Co. | 259 | 8 | 0,06 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 102 | 0,79 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 12.810** | **99,53** |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Anlagen** | **$ 12.810** | **99,53** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | |
| **ANZ National Bank** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 1 | $ 1 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | 31 | 31 | 0,24 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | 1 | 1 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Citibank N.A.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 10 | $ | 10 | 0,08 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 9 | | 9 | 0,07 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$** | **52** | **0,40** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$** | **8** | **0,07** |
| **Nettovermögen** | | | **$** | **12.870** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 12.810 | $ 0 | $ 0 | $ 12.810 |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

**(b) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 99,53 | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO RAE Fundamental US Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | |
| AT&T, Inc. | 10.906 | $ 384 |
| Exxon Mobil Corp. | 4.645 | 379 |
| Apple, Inc. | 2.767 | 334 |
| International Business Machines Corp. | 2.083 | 323 |
| Chevron Corp. | 3.092 | 291 |
| JPMorgan Chase & Co. | 4.162 | 280 |
| Microsoft Corp. | 5.348 | 251 |
| Intel Corp. | 7.964 | 250 |
| Verizon Communications, Inc. | 3.706 | 172 |
| Pfizer, Inc. | 5.171 | 172 |
| ConocoPhillips | 2.979 | 167 |
| Cisco Systems, Inc. | 5.891 | 160 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 2.277 | 151 |
| Johnson & Johnson | 1.442 | 142 |
| Citigroup, Inc. | 2.535 | 138 |
| Wells Fargo & Co. | 2.430 | 137 |
| Procter & Gamble Co. | 1.722 | 136 |
| Hewlett-Packard Co. | 4.454 | 134 |
| Philip Morris International, Inc. | 1.559 | 130 |
| General Electric Co. | 4.596 | 128 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| Intel Corp. | 1.114 | $ 35 |
| AT&T, Inc. | 964 | 32 |
| Microsoft Corp. | 496 | 22 |
| Medtronic PLC | 237 | 18 |
| Prudential Financial, Inc. | 217 | 18 |
| Johnson & Johnson | 147 | 14 |
| Altria Group, Inc. | 246 | 13 |
| Baxalta, Inc. | 373 | 13 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 89 | 12 |
| Federated Investors, Inc. | 354 | 11 |
| Morgan Stanley | 313 | 11 |
| Raymond James Financial, Inc. | 201 | 11 |
| Alcoa, Inc. | 1.131 | 11 |
| Eli Lilly & Co. | 128 | 11 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 92 | 10 |
| Amgen, Inc. | 61 | 10 |
| Cincinnati Financial Corp. | 187 | 10 |
| Reynolds American, Inc. | 115 | 10 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 157 | 9 |
| MetLife, Inc. | 183 | 9 |

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| **Republic of Azerbaijan International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 18.03.2024 | $ | 1.000 | $ 937 | 0,31 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 2.693 | 2.060 | 0,69 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2020 | | 670 | 669 | 0,22 |
| **Banco do Nordeste do Brasil S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.05.2019 | | 230 | 206 | 0,07 |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 1.050 | 1.037 | 0,35 |
| 6,500 % fällig am 10.06.2019 | | 2.100 | 2.063 | 0,69 |
| **Brazil Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.01.2025 | | 400 | 322 | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | | 2.770 | 1.863 | 0,62 |
| 5,625 % fällig am 07.01.2041 | | 600 | 438 | 0,15 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 18.300 | 3.417 | 1,14 |
| **Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | $ | 3.710 | 2.810 | 0,94 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 13.276 | 2.680 | 0,89 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2023 | | 77 | 15 | 0,01 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 3.170 | 573 | 0,19 |
| **Caixa Economica Federal** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2018 | $ | 2.200 | 2.032 | 0,68 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | | 1.000 | 793 | 0,26 |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 800 | 724 | 0,24 |
| **Compania Brasileira de Aluminio** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.06.2024 | | 1.500 | 1.230 | 0,41 |
| **Samarco Mineracao S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.09.2024 | | 1.000 | 335 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 24.10.2023 | | 1.300 | 429 | 0,14 |
| | | | 23.696 | 7,91 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 1.600 | 1.200 | 0,40 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 20.03.2017 | | 1.400 | 1.437 | 0,48 |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | | 800 | 847 | 0,28 |
| 7,875 % fällig am 13.03.2018 | | 600 | 641 | 0,22 |
| | | | 4.125 | 1,38 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **CAR, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 04.02.2020 | | 400 | 413 | 0,14 |
| **Lamar Funding Ltd.** | | | | |
| 3,958 % fällig am 07.05.2025 | | 1.200 | 1.072 | 0,36 |
| **Lima Metro Line 2 Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 1.100 | 1.073 | 0,36 |
| **Odebrecht Drilling Norbe VIII/IX Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 30.06.2021 | | 1.963 | 726 | 0,24 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.10.2022 | | 1.930 | 444 | 0,15 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2022 | | 1.250 | 300 | 0,10 |
| **Peru Enhanced Pass-Through Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2018 | | 67 | 64 | 0,02 |
| | | | 4.092 | 1,37 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.09.2022 | | 350 | 349 | 0,12 |
| **Celulosa Arauco y Constitucion S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2024 | | 300 | 298 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 21.01.2021 | | 300 | 313 | 0,10 |
| **Chile Government International Bond** | | | | |
| 3,625 % fällig am 30.10.2042 | | 200 | 175 | 0,06 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 4,250 % fällig am 17.07.2042 | $ | 1.500 | $ 1.109 | 0,37 |
| 4,500 % fällig am 16.09.2025 | | 1.600 | 1.511 | 0,50 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 700 | 563 | 0,19 |
| **Corpbanca S.A.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.09.2019 | | 500 | 497 | 0,17 |
| **Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.10.2024 | | 800 | 771 | 0,26 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 900 | 855 | 0,28 |
| **Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust A** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.11.2027 | | 1.100 | 1.034 | 0,34 |
| | | | 7.475 | 2,49 |
| **CHINA** | | | | |
| **CCCI Treasure Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2049 | | 900 | 887 | 0,30 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 | | 100 | 99 | 0,03 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.07.2025 | | 200 | 199 | 0,07 |
| | | | 1.185 | 0,40 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 200 | 194 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | | 750 | 830 | 0,28 |
| 8,125 % fällig am 21.05.2024 | | 500 | 601 | 0,20 |
| 10,375 % fällig am 28.01.2033 | | 800 | 1.134 | 0,38 |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.09.2023 | | 300 | 277 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 1.900 | 1.358 | 0,45 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 400 | 337 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 23.07.2019 | | 800 | 870 | 0,29 |
| | | | 5.601 | 1,87 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2023 | | 200 | 176 | 0,06 |
| 4,375 % fällig am 30.04.2025 | | 1.100 | 930 | 0,31 |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | | 1.200 | 867 | 0,29 |
| | | | 1.973 | 0,66 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Dominican Republic Government International Bond** | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | | 600 | 581 | 0,19 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 400 | 379 | 0,13 |
| | | | 960 | 0,32 |
| **EL SALVADOR** | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.01.2025 | | 5.700 | 4.788 | 1,60 |
| 7,375 % fällig am 01.12.2019 | | 2.050 | 2.058 | 0,69 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | | 100 | 99 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 01.02.2041 | | 900 | 766 | 0,25 |
| 7,650 % fällig am 15.06.2035 | | 100 | 86 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 24.01.2023 | | 110 | 108 | 0,04 |
| | | | 7.905 | 2,64 |
| **ÄTHIOPIEN** | | | | |
| **Ethiopia International Bond** | | | | |
| 6,625 % fällig am 11.12.2024 | | 200 | 178 | 0,06 |
| **GABUN** | | | | |
| **Gabon Government International Bond** | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.12.2024 | | 2.217 | 1.769 | 0,59 |
| **GHANA** | | | | |
| **Republic of Ghana International Bond** | | | | |
| 8,125 % fällig am 18.01.2026 | | 200 | 157 | 0,05 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| **Guatemala Government Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 13.02.2028 | | 2.200 | 2.117 | 0,71 |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | $ | 1.370 | $ 1.442 | 0,48 |
| | | | 3.559 | 1,19 |
| **INDIEN** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 31.07.2024 | | 600 | 503 | 0,17 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.07.2021 | € | 300 | 323 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 08.01.2026 | $ | 400 | 396 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 13.03.2020 | | 460 | 500 | 0,17 |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037 | | 420 | 441 | 0,15 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 7.100 | 7.628 | 2,54 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 180 | 211 | 0,07 |
| 8,500 % fällig am 12.10.2035 | | 410 | 512 | 0,17 |
| 11,625 % fällig am 04.03.2019 | | 3.870 | 4.870 | 1,62 |
| **Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.04.2017 | | 300 | 303 | 0,10 |
| **Majapahit Holding BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | | 1.500 | 1.682 | 0,56 |
| 7,875 % fällig am 29.06.2037 | | 1.190 | 1.291 | 0,43 |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | | 1.620 | 1.818 | 0,61 |
| **Pelabuhan Indonesia II PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 600 | 534 | 0,18 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 200 | 159 | 0,05 |
| **Pelabuhan Indonesia III PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 600 | 567 | 0,19 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 4,300 % fällig am 20.05.2023 | | 3.900 | 3.555 | 1,19 |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 2.200 | 1.810 | 0,60 |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | | 2.600 | 2.272 | 0,76 |
| | | | 28.872 | 9,63 |
| **IRLAND** | | | | |
| **Metalloinvest Finance Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.04.2020 | | 500 | 482 | 0,16 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance Ltd.** | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 3.300 | 2.933 | 0,98 |
| **OJSC Novolipetsk Steel via Steel Funding Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 19.02.2018 | | 800 | 792 | 0,26 |
| **Rosneft Oil Co. via Rosneft International Finance Ltd.** | | | | |
| 3,149 % fällig am 06.03.2017 | | 300 | 296 | 0,10 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 600 | 838 | 0,28 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | |
| 6,025 % fällig am 05.07.2022 | $ | 3.030 | 2.877 | 0,96 |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | | 800 | 812 | 0,27 |
| | | | 9.030 | 3,01 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **Delek & Avner Tamar Bond Ltd.** | | | | |
| 5,082 % fällig am 30.12.2023 | | 900 | 908 | 0,30 |
| 5,412 % fällig am 30.12.2025 | | 800 | 807 | 0,27 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.11.2024 | | 2.700 | 2.760 | 0,92 |
| | | | 4.475 | 1,49 |
| **JAMAIKA** | | | | |
| **Jamaica Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 28.04.2028 | | 400 | 398 | 0,13 |
| 7,875 % fällig am 28.07.2045 | | 200 | 195 | 0,07 |
| | | | 593 | 0,20 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **KazAgro National Management Holding JSC** | | | | |
| 3,255 % fällig am 22.05.2019 | € | 900 | 920 | 0,31 |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 2.100 | 2.077 | 0,69 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 800 | 790 | 0,26 |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 09.04.2021 | | 4.656 | 4.810 | 1,61 |
| 7,000 % fällig am 05.05.2020 | | 3.764 | 3.996 | 1,33 |
| **Samruk-Energy JSC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.12.2017 | | 1.200 | 1.176 | 0,39 |
| | | | 13.769 | 4,59 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **ContourGlobal Power Holdings S.A.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.06.2019 | $ | 200 | $ 190 | 0,06 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 400 | 355 | 0,12 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 06.02.2020 | | 600 | 559 | 0,19 |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 100 | 142 | 0,05 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ | 1.200 | 1.200 | 0,40 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 2.420 | 2.442 | 0,81 |
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | | 2.250 | 2.247 | 0,75 |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 300 | 336 | 0,11 |
| **Russian Agricultural Bank OJSC Via RSHB Capital S.A.** | | | | |
| 6,299 % fällig am 15.05.2017 | | 2.370 | 2.412 | 0,80 |
| 7,750 % fällig am 29.05.2018 | | 190 | 200 | 0,07 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 07.02.2017 | | 200 | 202 | 0,07 |
| 5,180 % fällig am 28.06.2019 | | 1.200 | 1.209 | 0,40 |
| 5,500 % fällig am 26.02.2024 | | 700 | 618 | 0,21 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 200 | 198 | 0,07 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 2.000 | 2.014 | 0,67 |
| | | | 14.324 | 4,78 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 2.000 | 110 | 0,04 |
| **Banco Santander Mexico S.A. Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | $ | 150 | 150 | 0,05 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 150 | 165 | 0,05 |
| **Comision Federal de Electricidad** | | | | |
| 4,875 % fällig am 26.05.2021 | | 400 | 406 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 14.02.2042 | | 1.425 | 1.290 | 0,43 |
| 6,125 % fällig am 16.06.2045 | | 700 | 646 | 0,21 |
| **Corporation GEO SAB de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 (a) | | 500 | 11 | 0,00 |
| **Grupo Televisa SAB** | | | | |
| 5,000 % fällig am 13.05.2045 | | 200 | 173 | 0,06 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 700 | 560 | 0,19 |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | $ | 300 | 263 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 24.01.2022 | | 3.700 | 3.570 | 1,19 |
| 5,500 % fällig am 24.02.2025 | € | 200 | 224 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2044 | $ | 5.140 | 3.893 | 1,30 |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045 | | 900 | 766 | 0,26 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 11.150 | 9.695 | 3,23 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 2.320 | 2.085 | 0,70 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 130 | 115 | 0,04 |
| | | | 24.122 | 8,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.04.2023 | € | 100 | 113 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | | 1.300 | 1.183 | 0,39 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | $ | 2.241 | 1.992 | 0,66 |
| 5,550 % fällig am 21.01.2045 | | 1.540 | 1.585 | 0,53 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 | | 1.500 | 1.406 | 0,47 |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 2.908 | 3.195 | 1,07 |
| | | | 9.474 | 3,16 |
| Summe Mexiko | | | 33.596 | 11,21 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 05.01.2018 | | 1.700 | 1.562 | 0,52 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 5,500 % fällig am 11.12.2042 | | 1.000 | 966 | 0,32 |
| **NAMIBIA** | | | | |
| **Namibia International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | | 300 | 280 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **CIMPOR Financial Operations BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | $ | 3.500 | $ 2.363 | 0,79 |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 06.10.2020 | | 3.100 | 3.063 | 1,02 |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 200 | 176 | 0,06 |
| | | | 5.602 | 1,87 |
| **PANAMA** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053 | | 400 | 343 | 0,11 |
| 7,125 % fällig am 29.01.2026 | | 880 | 1.102 | 0,37 |
| 8,875 % fällig am 30.09.2027 | | 650 | 902 | 0,30 |
| 9,375 % fällig am 16.01.2023 | | 180 | 243 | 0,08 |
| 9,375 % fällig am 01.04.2029 | | 200 | 289 | 0,10 |
| | | | 2.879 | 0,96 |
| **PARAGUAY** | | | | |
| **Republic of Paraguay International Bond** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.01.2023 | | 500 | 488 | 0,16 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 1.400 | 1.344 | 0,45 |
| | | | 1.832 | 0,61 |
| **PERU** | | | | |
| **Corporation Financiera de Desarrollo S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.02.2022 | | 1.300 | 1.326 | 0,44 |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 200 | 188 | 0,06 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2026 | € | 500 | 541 | 0,18 |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | $ | 390 | 452 | 0,15 |
| **Union Andina de Cementos SAA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2021 | | 300 | 290 | 0,10 |
| | | | 2.797 | 0,93 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.10.2025 | € | 400 | 441 | 0,15 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | $ | 1.800 | 1.711 | 0,57 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2043 | | 200 | 196 | 0,07 |
| **SCF Capital Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 27.10.2017 | | 3.200 | 3.180 | 1,06 |
| **Sibur Securities Ltd.** | | | | |
| 3,914 % fällig am 31.01.2018 | | 600 | 584 | 0,19 |
| | | | 5.671 | 1,89 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 8,750 % fällig am 13.05.2021 | | 500 | 526 | 0,18 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **Theta Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 14.11.2020 | | 215 | 202 | 0,07 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | | 1.300 | 1.437 | 0,48 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2020 | | 300 | 265 | 0,09 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 26.01.2021 | | 3.300 | 2.883 | 0,96 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | | 4.200 | 3.664 | 1,22 |
| **Myriad International Holdings BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.07.2025 | | 800 | 773 | 0,26 |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.07.2026 | € | 400 | 407 | 0,13 |
| 4,665 % fällig am 17.01.2024 | $ | 1.500 | 1.431 | 0,48 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Transnet SOC Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.07.2022 | $ | 400 | $ 355 | 0,12 |
| | | | 9.778 | 3,26 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 6.400 | 7.591 | 2,53 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **National Savings Bank** | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | $ | 600 | 561 | 0,19 |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 11.04.2019 | | 1.500 | 1.432 | 0,48 |
| 6,250 % fällig am 04.10.2020 | | 3.600 | 3.488 | 1,16 |
| | | | 5.481 | 1,83 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| **Africa Finance Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 29.04.2020 | | 400 | 403 | 0,13 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB** | | | | |
| 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 300 | 314 | 0,10 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **Tanzania Government International Bond** | | | | |
| 6,538 % fällig am 09.03.2020 | | 300 | 284 | 0,09 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | | |
| **Petroleum Co. of Trinidad & Tobago Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.05.2022 | | 1.154 | 1.079 | 0,36 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **Export Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.04.2019 | | 2.000 | 2.069 | 0,69 |
| **KOC Holding** | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.04.2020 | | 300 | 288 | 0,10 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043 | | 400 | 353 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 30.05.2040 | | 4.200 | 4.681 | 1,56 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 1.230 | 1.380 | 0,46 |
| 7,000 % fällig am 11.03.2019 | | 5.145 | 5.642 | 1,88 |
| 7,250 % fällig am 05.03.2038 | | 200 | 235 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 14.07.2017 | | 900 | 965 | 0,32 |
| **Turkish Airlines 2015-1 Class A Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2027 | | 391 | 376 | 0,12 |
| **Turkiye Garanti Bankasi** | | | | |
| 2,817 % fällig am 20.04.2016 | | 600 | 600 | 0,20 |
| | | | 16.589 | 5,53 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **DP World Ltd.** | | | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 380 | 375 | 0,12 |
| **Dubai Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 30.01.2043 | | 200 | 170 | 0,06 |
| | | | 545 | 0,18 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Afren PLC** | | | | |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 (a) | | 293 | 6 | 0,00 |
| 15,000 % fällig am 25.04.2016 (e) | | 900 | 369 | 0,12 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 900 | 1.329 | 0,45 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 100 | 201 | 0,07 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 209 | 0,07 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 300 | 450 | 0,15 |
| | | | 2.564 | 0,86 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **USA** | | | |
| California Resources Corp. | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | $ 115 | $ 41 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | 115 | 37 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | 616 | 326 | 0,11 |
| CCO Safari II LLC | | | |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | 400 | 400 | 0,13 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,179 % fällig am 29.01.2016 | 800 | 800 | 0,27 |
| 0,239 % fällig am 27.01.2016 | 2.300 | 2.300 | 0,77 |
| 0,246 % fällig am 22.01.2016 | 600 | 600 | 0,20 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | 400 | 400 | 0,13 |
| 0,261 % fällig am 26.01.2016 | 3.800 | 3.800 | 1,27 |
| 0,265 % fällig am 25.01.2016 | 200 | 200 | 0,07 |
| 0,310 % fällig am 28.01.2016 | 700 | 700 | 0,23 |
| 0,325 % fällig am 03.03.2016 | 100 | 100 | 0,03 |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | 3.900 | 3.899 | 1,30 |
| 0,332 % fällig am 10.02.2016 | 1.700 | 1.699 | 0,57 |
| 0,368 % fällig am 01.02.2016 | $ 1.700 | $ 1.700 | 0,57 |
| 0,380 % fällig am 09.02.2016 | 800 | 800 | 0,27 |
| Rio Oil Finance Trust Series 2014-1 | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 4.450 | 3.298 | 1,10 |
| Rio Oil Finance Trust Series 2014-3 | | | |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | 2.000 | 1.472 | 0,49 |
| Terraform Global Operating LLC | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2022 | 400 | 321 | 0,11 |
| | | 22.893 | 7,64 |
| **URUGUAY** | | | |
| Uruguay Government International Bond | | | |
| 4,375 % fällig am 27.10.2027 | 1.700 | 1.679 | 0,56 |
| 7,625 % fällig am 21.03.2036 | 1.080 | 1.339 | 0,45 |
| 7,875 % fällig am 15.01.2033 | 1.230 | 1.537 | 0,51 |
| | | 4.555 | 1,52 |
| **SAMBIA** | | | |
| Zambia Government International Bond | | | |
| 5,375 % fällig am 20.09.2022 | $ 300 | $ 218 | 0,07 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (b)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 2.999.603 | 30.002 | 10,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 295.265** | **98,50** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 2.450 | $ (45) | (0,02) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ (45)** | **(0,02)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,000 | 28.03.2016 | $ 1.700 | $ 76 | $ 90 | 0,03 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,000 | 28.03.2016 | 1.000 | 44 | 53 | 0,02 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BPS | JPY 119,000 | 13.01.2016 | 13.000 | 72 | 26 | 0,01 |
| | | | | | $ 192 | $ 169 | 0,06 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,130 | 09.02.2016 | € 2.800 | $ (19) | $ (6) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 4,300 | 28.03.2016 | $ 1.700 | (36) | (44) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 4,300 | 28.03.2016 | 1.000 | (21) | (26) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 3,800 | 28.03.2016 | 1.700 | (35) | (26) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | 3,800 | 28.03.2016 | 1.000 | (21) | (15) | (0,01) |
| | | | | | $ (132) | $ (117) | (0,04) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | BRC | $ 5.660 | $ 579 | $ 552 | $ 27 | 0,19 |
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | CBK | 2.000 | 205 | 193 | 12 | 0,07 |
| South Africa Government International Bond | (1,000 %) | 20.12.2020 | GST | 800 | 82 | 77 | 5 | 0,03 |
| | | | | | $ 866 | $ 822 | $ 44 | 0,29 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | BOA | $ 400 | $ (58) | $ (24) | $ (34) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BRC | 400 | (4) | (5) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 400 | (66) | (54) | (12) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 900 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 100 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 2.000 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 200 | (2) | (2) | 0 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 100 | (11) | (5) | (6) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 200 | (29) | (12) | (17) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 300 | (50) | (41) | (9) | (0,02) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | HUS | 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 5.000 | (778) | (414) | (364) | (0,26) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 100 | (16) | (13) | (3) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | JPM | 200 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 4.200 | (694) | (574) | (120) | (0,23) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 300 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 1.400 | 1 | 15 | (14) | 0,00 |
| Chile Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 700 | 1 | 7 | (6) | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 100 | 1 | (5) | 6 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 300 | 2 | (15) | 17 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 1.400 | 14 | 13 | 1 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | FBF | 500 | 3 | (25) | 28 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 1.100 | (27) | (9) | (18) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BOA | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 300 | (17) | (16) | (1) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 200 | (7) | (1) | (6) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 600 | (15) | (5) | (10) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 1.700 | (49) | (16) | (33) | (0,02) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 600 | (20) | 3 | (23) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | DUB | 200 | (11) | (11) | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | FBF | 200 | (11) | (10) | (1) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 1.000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 700 | (23) | 1 | (24) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | HUS | 400 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | HUS | 1.900 | (62) | (11) | (51) | (0,02) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | HUS | 5.000 | (233) | (101) | (132) | (0,08) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | JPM | 300 | (7) | (2) | (5) | 0,00 |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 1.100 | (36) | 6 | (42) | (0,01) |
| Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 1.000 | (29) | (10) | (19) | (0,01) |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.09.2016 | FBF | 400 | 2 | (10) | 12 | 0,00 |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | BRC | 200 | (25) | (27) | 2 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | CBK | 300 | (38) | (41) | 3 | (0,01) |
| Indonesia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2024 | GST | 200 | (25) | (27) | 2 | (0,01) |
| Malaysia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 2.600 | (7) | (32) | 25 | 0,00 |
| Malaysia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | DUB | 300 | (7) | (3) | (4) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | BRC | 200 | (3) | 1 | (4) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 3.300 | (40) | (19) | (21) | (0,01) |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | FBF | 600 | (6) | (5) | (1) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 2.000 | (19) | (14) | (5) | (0,01) |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 100 | (1) | 1 | (2) | 0,00 |
| Panama Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 500 | (7) | 3 | (10) | 0,00 |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 200 | (7) | (8) | 1 | 0,00 |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 1.500 | (16) | (20) | 4 | (0,01) |
| Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | FBF | 2.300 | (32) | (33) | 1 | (0,01) |
| Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 1.400 | (70) | (27) | (43) | (0,02) |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | BOA | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 700 | (3) | (10) | 7 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | BRC | 800 | (3) | (17) | 14 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 2.100 | (101) | (67) | (34) | (0,03) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 600 | (55) | (75) | 20 | (0,02) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | CBK | 2.000 | (144) | (319) | 175 | (0,05) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 300 | (28) | (26) | (2) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | GST | 300 | (1) | (6) | 5 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 400 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | JPM | 200 | (17) | (23) | 6 | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 500 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 1.300 | (124) | (77) | (47) | (0,04) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 300 | (29) | (19) | (10) | (0,01) |
| South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 400 | (38) | (23) | (15) | (0,01) |
| Turkey Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | HUS | 200 | (7) | (11) | 4 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 400 | (1) | (4) | 3 | 0,00 |
| | | | | | $ (3.092) | $ (2.280) | $ (812) | (1,03) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 15,510 % | 01.07.2016 | HUS | BRL 100 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,600 % | 02.01.2017 | BOA | 4.100 | (120) | (11) | (109) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 8,650 % | 02.01.2017 | JPM | 4.300 | (124) | 7 | (131) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 10,630 % | 02.01.2017 | HUS | 6.900 | (102) | (6) | (96) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 10,770 % | 02.01.2017 | DUB | 1.500 | (20) | 0 | (20) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 10,920 % | 02.01.2017 | MYC | 200 | (2) | 1 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | BPS | 16.600 | 98 | (20) | 118 | 0,03 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,255 % | 02.01.2017 | DUB | 12.000 | 71 | (15) | 86 | 0,02 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,820 % | 02.01.2017 | HUS | 27.700 | 117 | (1) | 118 | 0,04 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 13,900 % | 02.01.2017 | BPS | 4.000 | 16 | 2 | 14 | 0,01 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | BPS | 16.900 | (10) | 2 | (12) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,230 % | 02.01.2017 | DUB | 7.000 | (4) | 0 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | UAG | 12.660 | (205) | 12 | (217) | (0,07) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | BPS | 4.600 | 74 | 27 | 47 | 0,02 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | HUS | 16.800 | 272 | 218 | 54 | 0,09 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,860 % | 02.01.2018 | BPS | 7.400 | (102) | (86) | (16) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 13,730 % | 02.01.2018 | GLM | 10.300 | (102) | (2) | (100) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | HUS | 500 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | BPS | 3.800 | 127 | 3 | 124 | 0,04 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 1.300 | (36) | (2) | (34) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 2.600 | (72) | (3) | (69) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 10.200 | (249) | 28 | (277) | (0,08) |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 12,850 % | 04.01.2021 | BPS | 22.010 | 462 | 423 | 39 | 0,16 |
| Erhalt | BRL-CDI-Compounded | 16,150 % | 04.01.2021 | DUB | 12.200 | 23 | 8 | 15 | 0,01 |
| | | | | | | $ 111 | $ 585 | $ (474) | 0,04 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 1.986 | $ | 513 | BOA | $ 11 | $ 0 | $ 11 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 509 | BRL | 1.986 | BOA | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.299 | | 8.984 | BPS | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 8.984 | $ | 2.301 | BPS | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 3.692 | BRL | 14.329 | DUB | 0 | (70) | (70) | (0,02) |
| 01/2016 | BRL | 14.329 | $ | 3.665 | DUB | 43 | 0 | 43 | 0,01 |
| 01/2016 | | 4.180 | | 1.071 | FBF | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.076 | BRL | 4.180 | FBF | 0 | (19) | (19) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 1.643 | $ | 421 | GLM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 424 | BRL | 1.643 | GLM | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.112 | $ | 282 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 285 | BRL | 1.112 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.531 | | 14.420 | HUS | 0 | (279) | (279) | (0,09) |
| 01/2016 | | 14.780 | | 13.531 | UAG | 0 | (81) | (81) | (0,03) |
| 01/2016 | JPY | 29.800 | | 244 | GLM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 246 | JPY | 29.800 | MSB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 551.023 | $ | 480 | GLM | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 8.984 | | 2.277 | BPS | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 660 | BRL | 2.610 | DUB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 11.566 | $ | 3.151 | MSB | 257 | 0 | 257 | 0,09 |
| 02/2016 | € | 13.531 | | 14.790 | UAG | 81 | 0 | 81 | 0,03 |
| 02/2016 | £ | 1.971 | | 2.991 | JPM | 86 | 0 | 86 | 0,03 |
| 02/2016 | JPY | 29.800 | | 246 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.182 | | 840 | SCX | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 32.271 | | 898 | FBF | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 52.455 | | 1.606 | GLM | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| 03/2016 | $ | 2.992 | MXN | 51.302 | GLM | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| 07/2016 | BRL | 25.958 | $ | 6.570 | BPS | 394 | 0 | 394 | 0,13 |
| 10/2016 | $ | 1.208 | BRL | 5.255 | BPS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 10/2016 | BRL | 7.032 | $ | 1.934 | DUB | 313 | 0 | 313 | 0,10 |
| 10/2016 | | 5.247 | | 1.208 | GLM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.309 | $ (549) | $ 760 | 0,25 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (1.303)** | **(0,43)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 293.917** | **98,05** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 23 | $ 34 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 13 | 13 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 18.420 | 153 | 0,05 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 358 | 358 | 0,12 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 41 | 5 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 182 | 1 | 0,00 |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 28 | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 112 | 112 | 0,04 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 132 | 9 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 107 | 107 | 0,04 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 23 | 3 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 7 | 5 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 22 | 24 | 0,01 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 7.758 | 64 | 0,02 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 7 | 11 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 907** | **0,30** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 4.926** | **1,65** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 299.750** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(b) **Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(c) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 1.760 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

(d) **Barmittel in Höhe von USD 496 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(e) **Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 15,000 % | 25.04.2016 | 30.04.2015 | $ 869 | $ 369 | 0,12 |

### (f) Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 30.002 | $ 264.894 | $ 369 | $ 295.265 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (1.348) | 0 | (1.348) |
| **Summen** | **$ 30.002** | **$ 263.546** | **$ 369** | **$ 293.917** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14.720 | $ 308.743 | $ 0 | $ 323.463 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (1.029) | 0 | (1.029) |
| **Summen** | **$ 14.720** | **$ 307.714** | **$ 0** | **$ 322.434** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Investor EUR (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 27.110 | $ | 29.788 | BOA | $ 339 | $ 0 | $ 339 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 29.863 | € | 28.010 | BOA | 564 | 0 | 564 | 0,19 |
| 01/2016 | | 86 | | 79 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 4 | $ | 4 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.795 | | 1.950 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 308 | € | 282 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1.605 | $ | 1.734 | CBK | 9 | (19) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 35 | € | 33 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 22.537 | | 21.270 | GLM | 568 | 0 | 568 | 0,19 |
| 01/2016 | € | 27.110 | $ | 29.792 | HUS | 343 | 0 | 343 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 29.785 | € | 27.950 | HUS | 576 | 0 | 576 | 0,19 |
| 01/2016 | € | 22.779 | $ | 24.892 | JPM | 147 | 0 | 147 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 174 | € | 164 | NAB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | | 68 | | 63 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 37 | | 34 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 27.214 | $ | 29.726 | UAG | 163 | 0 | 163 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 29.694 | € | 27.942 | UAG | 659 | 0 | 659 | 0,22 |
| 02/2016 | | 29.835 | | 27.133 | BOA | 0 | (339) | (339) | (0,11) |
| 02/2016 | | 29.813 | | 27.110 | HUS | 0 | (343) | (343) | (0,11) |
| 02/2016 | € | 564 | $ | 617 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 24.909 | € | 22.779 | JPM | 0 | (147) | (147) | (0,05) |
| 02/2016 | | 29.677 | | 27.150 | UAG | 0 | (163) | (163) | (0,05) |
| | | | | | | $ 3.377 | $ (1.013) | $ 2.364 | 0,79 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class und Investor NOK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | NOK | 1.510 | $ | 173 | BOA | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 180 | NOK | 1.558 | BPS | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 106 | $ | 12 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 17 | | 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 61 | | 7 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 155 | NOK | 1.345 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 180 | | 1.559 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 1.509 | $ | 174 | JPM | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 179 | NOK | 1.555 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 1.411 | $ | 162 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.509 | | 174 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 173 | NOK | 1.510 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 174 | | 1.509 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | NOK | 35 | $ | 4 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 162 | NOK | 1.411 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 174 | | 1.509 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ 12 | $ (25) | $ (13) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Investor SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 82 | SEK | 712 | BOA | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 90 | | 786 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 67 | $ | 8 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 90 | SEK | 787 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 865 | $ | 103 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 17 | | 2 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 735 | | 88 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 85 | SEK | 746 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 735 | $ | 88 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 88 | SEK | 735 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 88 | | 735 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 88 | | 735 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 15 | $ (3) | $ 12 | 0,00 |

**(h) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class und Investor EUR (Hedged) Class die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 2.343 | $ 2.557 | $ (10) | $ 0 | $ (10) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 170 | $ (430) | $ (260) |
| BPS | 1.117 | (1.150) | (33) |
| BRC | 286 | (270) | 16 |
| CBK | (27) | 220 | 193 |
| DUB | (34) | (200) | (234) |
| FBF | (27) | 40 | 13 |
| GLM | 451 | (720) | (269) |
| GST | (79) | 270 | 191 |
| HUS | (552) | 460 | (92) |
| JPM | (806) | 770 | (36) |
| MSB | 260 | (320) | (60) |
| MYC | (173) | 0 | (173) |
| NAB | 4 | 0 | 4 |
| SCX | 5 | 0 | 5 |
| UAG | 455 | (730) | (275) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,50 | 99,32 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,02) | (0,06) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,43) | (0,26) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 9.403.269 | $ 94.095 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 29.04.2015 | $ | 9.800 | 9.799 |
| Federal Home Loan Bank 0,239 % fällig am 27.01.2016 | | 8.400 | 8.396 |
| Spain Government Bond 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 6.700 | 8.093 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional 0,000 % fällig am 01.01.2018 | BRL | 25.700 | 5.502 |
| Federal Home Loan Bank 0,261 % fällig am 26.01.2016 | $ | 5.500 | 5.497 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.05.2015 | | 4.800 | 4.799 |
| Federal Home Loan Bank 0,170 % fällig am 08.02.2016 | | 4.700 | 4.697 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 28.10.2015 | | 4.100 | 4.099 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.11.2015 | | 4.100 | 4.099 |
| Panama Government International Bond 8,875 % fällig am 30.09.2027 | | 2.750 | 3.927 |
| Federal Home Loan Bank 0,330 % fällig am 26.02.2016 | | 3.900 | 3.898 |
| Indonesia Government International Bond 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 2.500 | 3.233 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.01.2016 | | 3.000 | 2.999 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 3.100 | 2.990 |
| Turkey Government International Bond 6,750 % fällig am 30.05.2040 | | 2.500 | 2.974 |
| Federal Home Loan Bank 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 2.900 | 2.899 |
| Freddie Mac 0,000 % fällig am 10.02.2016 | | 2.800 | 2.799 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 20.08.2015 | | 2.700 | 2.700 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.01.2016 | | 2.600 | 2.599 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 7.874.781 | $ 78.800 |
| | **PARI (000S)** | |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 29.04.2015 | $ 9.800 | 9.799 |
| Russia Government International Bond 7,500 % fällig am 31.03.2030 | 6.124 | 6.904 |
| Federal Home Loan Bank 0,239 % fällig am 27.01.2016 | 6.100 | 6.098 |
| Petrobras Global Finance BV 7,875 % fällig am 15.03.2019 | 5.700 | 5.943 |
| Philippines Government International Bond 7,750 % fällig am 14.01.2031 | 3.300 | 4.898 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 22.05.2015 | 4.800 | 4.799 |
| Federal Home Loan Bank 0,170 % fällig am 08.02.2016 | 4.700 | 4.698 |
| Petrobras Global Finance BV 5,750 % fällig am 20.01.2020 | 4.730 | 4.543 |
| Panama Government International Bond 8,875 % fällig am 30.09.2027 | 3.000 | 4.189 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 28.10.2015 | 4.100 | 4.099 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 04.11.2015 | 4.100 | 4.099 |
| Slovenia Government International Bond 5,250 % fällig am 18.02.2024 | 2.800 | 3.127 |
| Turkey Government International Bond 7,000 % fällig am 05.06.2020 | 2.700 | 3.032 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 06.01.2016 | 3.000 | 3.000 |
| Freddie Mac 0,000 % fällig am 10.02.2016 | 2.800 | 2.799 |
| Indonesia Government International Bond 5,125 % fällig am 15.01.2045 | 2.600 | 2.718 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 20.08.2015 | 2.700 | 2.700 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.01.2016 | 2.600 | 2.599 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 8,625 % fällig am 28.04.2034 | 2.250 | 2.534 |

(a) Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | $ | 3.300 | $ 3.265 | 0,29 |
| **Chrysler Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.05.2017 | | 4.627 | 4.619 | 0,41 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 3,657 % fällig am 31.12.2018 | | 4.641 | 4.583 | 0,40 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,174 % fällig am 31.03.2017 | | 9.258 | 9.257 | 0,81 |
| | | | 21.724 | 1,91 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 3.400 | 3.417 | 0,30 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 2.500 | 2.506 | 0,22 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 0,932 % fällig am 31.07.2018 | | 8.100 | 8.075 | 0,71 |
| 1,114 % fällig am 05.11.2018 | | 2.100 | 2.102 | 0,18 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2018 | | 2.000 | 2.087 | 0,18 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.200 | 2.342 | 0,21 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 1.200 | 1.223 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 1,003 % fällig am 25.08.2017 | $ | 3.200 | 3.197 | 0,28 |
| 1,272 % fällig am 15.09.2026 | | 1.600 | 1.380 | 0,12 |
| 1,361 % fällig am 15.01.2019 | | 2.800 | 2.812 | 0,25 |
| 1,482 % fällig am 01.04.2019 | | 5.400 | 5.380 | 0,47 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 1.600 | 1.655 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2017 | | 700 | 749 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 1.200 | 1.325 | 0,12 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 0,812 % fällig am 15.06.2017 | | 3.500 | 3.473 | 0,30 |
| 0,832 % fällig am 14.02.2017 | | 4.600 | 4.594 | 0,40 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 1,234 % fällig am 17.08.2020 | | 1.900 | 1.906 | 0,17 |
| 2,600 % fällig am 17.08.2020 | | 1.100 | 1.105 | 0,10 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 1,002 % fällig am 05.03.2018 | | 6.500 | 6.466 | 0,57 |
| 2,300 % fällig am 05.03.2020 | | 3.900 | 3.848 | 0,34 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 6.700 | 7.642 | 0,67 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 1.300 | 1.389 | 0,12 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 3.600 | 4.251 | 0,37 |
| **BB&T Corp.** | | | | |
| 1,372 % fällig am 15.06.2018 | $ | 2.413 | 2.419 | 0,21 |
| **Bear Stearns Cos. LLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 02.10.2017 | | 13.300 | 14.327 | 1,26 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 2.300 | 2.363 | 0,21 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 0,934 % fällig am 18.11.2016 | | 1.400 | 1.401 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2025 | | 300 | 288 | 0,03 |
| **BPE Financiaciones S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.05.2016 | € | 10.900 | 11.942 | 1,05 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,747 % fällig am 09.06.2016 | $ | 2.300 | 2.293 | 0,20 |
| 0,849 % fällig am 01.05.2017 | | 1.300 | 1.295 | 0,11 |
| 1,280 % fällig am 25.07.2016 | | 5.500 | 5.509 | 0,48 |
| 1,312 % fällig am 07.12.2018 | | 4.500 | 4.489 | 0,39 |
| 1,630 % fällig am 26.10.2020 | | 1.600 | 1.616 | 0,14 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 1.300 | 1.291 | 0,11 |
| **Citizens Bank N.A.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 03.12.2018 | | 3.400 | 3.398 | 0,30 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.11.2049 | € | 900 | 924 | 0,08 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.11.2018 | $ | 700 | 695 | 0,06 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 29.01.2049 | € | 500 | $ 517 | 0,05 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,457 % fällig am 10.06.2020 | $ | 3.000 | 3.001 | 0,26 |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 1.400 | 1.566 | 0,14 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 200 | 205 | 0,02 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 200 | 221 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | £ | 7.000 | 10.316 | 0,91 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 200 | 211 | 0,02 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 5.200 | 5.207 | 0,46 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,753 % fällig am 30.03.2016 | | 2.700 | 2.707 | 0,24 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,048 % fällig am 22.05.2017 | | 6.700 | 6.693 | 0,59 |
| 1,312 % fällig am 15.12.2017 | | 300 | 300 | 0,03 |
| 1,336 % fällig am 23.10.2019 | | 10.600 | 10.639 | 0,93 |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 3.400 | 3.411 | 0,30 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 1,152 % fällig am 06.09.2017 | | 4.500 | 4.480 | 0,39 |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | | 2.000 | 1.996 | 0,18 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 219 | 0,02 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 1,114 % fällig am 07.08.2018 | $ | 2.700 | 2.700 | 0,24 |
| 2,350 % fällig am 05.03.2020 | | 6.600 | 6.527 | 0,57 |
| **Hutchison Whampoa International 12 II Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.11.2017 | | 250 | 250 | 0,02 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 2,351 % fällig am 13.11.2017 | | 1.310 | 1.315 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 21.11.2017 | | 3.300 | 3.322 | 0,29 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2016 | | 2.900 | 2.918 | 0,26 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 2.405 | 2.441 | 0,21 |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 200 | 206 | 0,02 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.01.2019 | | 800 | 824 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,271 % fällig am 23.01.2020 | | 6.900 | 6.912 | 0,61 |
| 1,529 % fällig am 29.10.2020 | | 3.400 | 3.437 | 0,30 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 6.000 | 6.555 | 0,58 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | € | 100 | 156 | 0,01 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 100 | 143 | 0,01 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 2.600 | 4.023 | 0,35 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 600 | 939 | 0,08 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 1,444 % fällig am 29.07.2020 | $ | 2.100 | 2.105 | 0,18 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 0,851 % fällig am 15.07.2016 | | 6.300 | 6.310 | 0,55 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 1,600 % fällig am 16.10.2017 | | 6.100 | 6.062 | 0,53 |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 1,507 % fällig am 20.10.2018 | | 700 | 707 | 0,06 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 0,666 % fällig am 23.05.2016 | | 1.100 | 1.101 | 0,10 |
| **PNC Bank N.A.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 05.11.2018 | | 2.400 | 2.395 | 0,21 |
| **Reliance Standard Life Global Funding II** | | | | |
| 2,150 % fällig am 15.10.2018 | | 1.400 | 1.392 | 0,12 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 700 | 731 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 318 | 0,03 |
| **Shinhan Bank** | | | | |
| 0,968 % fällig am 08.04.2017 | | 1.100 | 1.100 | 0,10 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 1,056 % fällig am 23.07.2018 | | 4.800 | 4.792 | 0,42 |
| 2,450 % fällig am 16.01.2020 | | 4.300 | 4.280 | 0,38 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.01.2019 | $ | 2.800 | $ 2.792 | 0,24 |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,303 % fällig am 26.03.2018 | | 4.500 | 4.494 | 0,39 |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | | 1.600 | 1.629 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 600 | 608 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 300 | 314 | 0,03 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 228 | 0,02 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 1.000 | 1.026 | 0,09 |
| **Wachovia Corp.** | | | | |
| 0,782 % fällig am 15.06.2017 | $ | 1.000 | 997 | 0,09 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.09.2017 | | 1.300 | 1.289 | 0,11 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 0,716 % fällig am 02.06.2017 | | 11.850 | 11.806 | 1,04 |
| 0,780 % fällig am 22.04.2019 | | 2.900 | 2.872 | 0,25 |
| | | | 281.079 | 24,67 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 14.05.2018 | | 5.655 | 5.632 | 0,49 |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.03.2017 | | 1.600 | 1.603 | 0,14 |
| 2,350 % fällig am 12.03.2018 | | 3.500 | 3.506 | 0,31 |
| **Actavis, Inc.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 01.10.2017 | | 1.100 | 1.099 | 0,10 |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 28.11.2017 | | 2.915 | 2.881 | 0,25 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 0,758 % fällig am 22.05.2017 | | 5.700 | 5.687 | 0,50 |
| **Anglo American Capital PLC** | | | | |
| 1,271 % fällig am 15.04.2016 | | 4.200 | 4.159 | 0,36 |
| **Becton Dickinson & Co.** | | | | |
| 0,962 % fällig am 15.06.2016 | | 1.600 | 1.599 | 0,14 |
| 1,800 % fällig am 15.12.2017 | | 1.100 | 1.099 | 0,10 |
| **BMW US Capital LLC** | | | | |
| 0,756 % fällig am 02.06.2017 | | 9.000 | 8.946 | 0,79 |
| **Canadian Natural Resources Ltd.** | | | | |
| 0,978 % fällig am 30.03.2016 | | 1.550 | 1.547 | 0,14 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 3.500 | 989 | 0,09 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 1.100 | 1.098 | 0,10 |
| 1,450 % fällig am 16.04.2016 | | 2.400 | 2.400 | 0,21 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 20.07.2018 | | 1.400 | 1.400 | 0,12 |
| **Daimler Finance N.A. LLC** | | | | |
| 0,837 % fällig am 10.03.2017 | | 2.300 | 2.288 | 0,20 |
| 2,700 % fällig am 03.08.2020 | | 1.800 | 1.783 | 0,16 |
| 3,875 % fällig am 15.09.2021 | | 2.760 | 2.869 | 0,25 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.03.2017 | | 1.800 | 1.812 | 0,16 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 1,095 % fällig am 17.01.2017 | | 1.400 | 1.390 | 0,12 |
| 1,594 % fällig am 09.05.2016 | | 6.900 | 6.910 | 0,61 |
| 2,240 % fällig am 15.06.2018 | | 3.100 | 3.074 | 0,27 |
| 3,200 % fällig am 15.01.2021 | | 1.800 | 1.790 | 0,16 |
| 4,250 % fällig am 03.02.2017 | | 400 | 409 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2018 | | 900 | 946 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2017 | | 2.800 | 2.986 | 0,26 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 0,624 % fällig am 29.01.2016 | | 600 | 600 | 0,05 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 2.675 | 2.683 | 0,24 |
| **Hutchison Whampoa Finance CI Ltd.** | | | | |
| 7,450 % fällig am 01.08.2017 | | 1.496 | 1.623 | 0,14 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.08.2016 | | 400 | 401 | 0,03 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 2,050 % fällig am 11.02.2018 | | 3.300 | 3.287 | 0,29 |
| **Kraft Foods Group, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 05.06.2017 | | 1.500 | 1.511 | 0,13 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 1.600 | 1.593 | 0,14 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Medtronic, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.03.2020 | $ | 2.600 | $ 2.620 | 0,23 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2016 | | 2.200 | 2.225 | 0,19 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.02.2016 | | 1.000 | 1.003 | 0,09 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 6,421 % fällig am 20.06.2016 | | 2.700 | 2.762 | 0,24 |
| **UAL 2009-1 Pass-Through Trust** | | | | |
| 10,400 % fällig am 01.11.2016 | | 105 | 111 | 0,01 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 0,804 % fällig am 18.11.2016 | | 1.935 | 1.907 | 0,17 |
| | | | 92.228 | 8,10 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,741 % fällig am 12.02.2016 | | 2.400 | 2.399 | 0,21 |
| 1,023 % fällig am 30.03.2017 | | 1.900 | 1.896 | 0,17 |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 2.200 | 2.187 | 0,19 |
| 1,700 % fällig am 01.06.2017 | | 1.800 | 1.806 | 0,16 |
| **BellSouth LLC** | | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | | 2.800 | 2.833 | 0,25 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 0,992 % fällig am 03.04.2017 | | 3.300 | 3.290 | 0,29 |
| **Duke Energy Progress LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2021 | | 2.000 | 2.040 | 0,18 |
| **Hydro Quebec** | | | | |
| 0,625 % fällig am 29.09.2049 | | 2.000 | 1.422 | 0,12 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 14.09.2016 | | 300 | 303 | 0,03 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | | 1.550 | 1.515 | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 1.000 | 987 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | | 1.840 | 1.835 | 0,16 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 0,877 % fällig am 09.06.2017 | | 5.500 | 5.479 | 0,48 |
| 2,042 % fällig am 15.09.2016 | | 6.000 | 6.038 | 0,53 |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 | | 3.800 | 3.893 | 0,34 |
| | | | 37.923 | 3,33 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 411.230 | 36,10 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Harris, Texas, Utility System Revenue Bonds, Series 2012** | | | | |
| 0,610 % fällig am 15.05.2034 | | 1.000 | 1.000 | 0,09 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,129 % fällig am 25.11.2022 | | 8.100 | 8.115 | 0,71 |
| 1,443 % fällig am 01.07.2044 | | 10 | 11 | 0,00 |
| 2,022 % fällig am 01.10.2034 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,122 % fällig am 01.11.2035 | | 12 | 13 | 0,00 |
| 2,274 % fällig am 01.09.2035 | | 85 | 90 | 0,01 |
| 2,387 % fällig am 01.07.2035 | | 54 | 58 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 25.10.2040 | | 3.969 | 4.075 | 0,36 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2036 | | 173 | 198 | 0,02 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 2,443 % fällig am 01.06.2035 | | 62 | 66 | 0,01 |
| 2,521 % fällig am 01.09.2035 | | 43 | 46 | 0,00 |
| 2,700 % fällig am 01.05.2031 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,692 % fällig am 20.03.2065 | | 2.245 | 2.243 | 0,20 |
| 0,892 % fällig am 20.10.2065 | | 4.239 | 4.250 | 0,37 |
| 1,420 % fällig am 01.01.2066 | | 5.400 | 5.446 | 0,48 |
| 1,625 % fällig am 20.10.2029 | | 35 | 37 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041 | | 1.318 | 1.364 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027 | | 72 | 73 | 0,01 |
| | | | 26.094 | 2,29 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (a)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 - 15.07.2024 (b)(c) | | 43.963 | 42.587 | 3,74 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b)(c) | | 30.627 | 29.262 | 2,57 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | $ | 12.436 | $ 12.050 | 1,06 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | | 9.797 | 8.566 | 0,75 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 (d)(e) | | 194.000 | 191.491 | 16,81 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | | 7.200 | 7.360 | 0,65 |
| **US Treasury Notes (d)** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 - 31.07.2020 (b)(c)(e) | | 153.600 | 152.903 | 13,42 |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 - 15.08.2025 | | 69.000 | 68.255 | 5,99 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 (e) | | 36.800 | 36.722 | 3,22 |
| | | | 549.196 | 48,21 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2047 | | 258 | 216 | 0,02 |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (f) | | 185 | 138 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.05.2047 | | 85 | 70 | 0,01 |
| 0,822 % fällig am 25.08.2035 | | 1.573 | 1.080 | 0,10 |
| 1,257 % fällig am 25.12.2035 | | 3.222 | 2.706 | 0,24 |
| **Alternative Loan Trust Resecuritization** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.09.2033 | | 448 | 413 | 0,04 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (f) | | 307 | 220 | 0,02 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,972 % fällig am 25.09.2034 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,558 % fällig am 10.06.2049 | | 511 | 525 | 0,05 |
| **Banc of America Funding Ltd.** | | | | |
| 0,503 % fällig am 03.10.2039 | | 972 | 957 | 0,08 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.05.2035 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,801 % fällig am 20.02.2036 | | 104 | 103 | 0,01 |
| **BBCMS Trust** | | | | |
| 1,481 % fällig am 15.05.2032 | | 8.600 | 8.548 | 0,75 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,578 % fällig am 25.01.2034 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,581 % fällig am 25.02.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,868 % fällig am 25.01.2034 | | 24 | 24 | 0,00 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 2,458 % fällig am 25.01.2036 (f) | | 189 | 156 | 0,01 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | | 25 | 21 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,852 % fällig am 25.12.2035 | | 4.500 | 4.131 | 0,36 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,566 % fällig am 26.12.2046 | | 1.665 | 1.232 | 0,11 |
| 2,693 % fällig am 26.01.2036 | | 8.134 | 6.724 | 0,59 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | CAD | 14.843 | 10.614 | 0,93 |
| **Chase Funding Trust** | | | | |
| 1,162 % fällig am 25.10.2032 | $ | 4 | 3 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 1,611 % fällig am 15.07.2027 | | 600 | 602 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,570 % fällig am 25.10.2035 (f) | | 352 | 350 | 0,03 |
| 2,660 % fällig am 25.05.2035 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 2,706 % fällig am 25.08.2035 (f) | | 689 | 514 | 0,05 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.08.2034 | | 253 | 242 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,142 % fällig am 25.07.2034 | | 4.318 | 4.016 | 0,35 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,311 % fällig am 15.12.2039 | | 941 | 951 | 0,08 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 0,824 % fällig am 25.03.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | | 7 | 6 | 0,00 |
| 2,312 % fällig am 25.06.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | | 62 | 63 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2036 | | 1.256 | 1.242 | 0,11 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.11.2045 | | 154 | 134 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.01.2034 | | 7 | 6 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 19.01.2038 | $ | 212 | $ 174 | 0,02 |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | | 80 | 67 | 0,01 |
| 4,730 % fällig am 19.08.2036 (f) | | 315 | 285 | 0,03 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 1,182 % fällig am 25.10.2033 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,120 % fällig am 25.08.2036 (f) | | 3.056 | 2.889 | 0,25 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | | 1.700 | 1.368 | 0,12 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,778 % fällig am 22.12.2054 | | 1.111 | 1.113 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,982 % fällig am 25.10.2034 | | 5 | 4 | 0,00 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.10.2046 | | 549 | 472 | 0,04 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,811 % fällig am 15.06.2030 | | 30 | 29 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.03.2037 | | 3.249 | 1.524 | 0,13 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.02.2036 | | 32 | 30 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.11.2035 | | 23 | 22 | 0,00 |
| 0,882 % fällig am 25.04.2029 | | 963 | 930 | 0,08 |
| 1,293 % fällig am 25.12.2029 | | 974 | 931 | 0,08 |
| 2,154 % fällig am 25.12.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,239 % fällig am 25.12.2034 | | 32 | 32 | 0,00 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,733 % fällig am 01.12.2050 | £ | 4.200 | 5.508 | 0,48 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 0,371 % fällig am 26.07.2036 | $ | 3.469 | 3.206 | 0,28 |
| **PFP Ltd.** | | | | |
| 1,767 % fällig am 14.07.2034 | | 1.500 | 1.502 | 0,13 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.02.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,962 % fällig am 25.03.2034 | | 376 | 356 | 0,03 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.09.2035 (f) | | 1.260 | 1.011 | 0,09 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,982 % fällig am 25.08.2035 | | 3.254 | 3.241 | 0,29 |
| 1,037 % fällig am 25.01.2035 | | 2.871 | 2.692 | 0,24 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 1,002 % fällig am 20.12.2034 | | 1.449 | 1.413 | 0,12 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 1,397 % fällig am 25.12.2035 | | 772 | 693 | 0,06 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,657 % fällig am 25.01.2035 | | 65 | 53 | 0,01 |
| 2,561 % fällig am 25.08.2034 | | 96 | 95 | 0,01 |
| 2,586 % fällig am 25.02.2034 | | 70 | 69 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.09.2047 | | 2.237 | 1.930 | 0,17 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | | 64 | 61 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2036 (f) | | 34 | 27 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.09.2043 | | 1.861 | 1.807 | 0,16 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 3.000 | 4.385 | 0,39 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.12.2045 | $ | 30 | 29 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | | 16 | 15 | 0,00 |
| 1,257 % fällig am 25.02.2046 | | 360 | 332 | 0,03 |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | | 9 | 8 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 25.08.2042 | | 13 | 12 | 0,00 |
| 1,899 % fällig am 27.02.2034 | | 18 | 17 | 0,00 |
| 2,439 % fällig am 25.03.2034 | | 30 | 30 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,439 % fällig am 25.05.2041 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 25.02.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,683 % fällig am 25.04.2035 | | 2.742 | 2.781 | 0,24 |
| 2,710 % fällig am 25.07.2036 (f) | | 981 | 960 | 0,09 |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 | | 68 | 68 | 0,01 |
| | | | 88.243 | 7,75 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction Nine Srl** | | | | |
| 0,575 % fällig am 10.12.2028 | € | 2.877 | $ 3.128 | 0,27 |
| **Fortress Credit Investments IV Ltd.** | | | | |
| 1,565 % fällig am 17.07.2023 | $ | 2.917 | 2.917 | 0,26 |
| **Franklin CLO VI Ltd.** | | | | |
| 0,574 % fällig am 09.08.2019 | | 5.645 | 5.534 | 0,49 |
| **Fraser Sullivan CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,362 % fällig am 20.04.2023 | | 2.546 | 2.544 | 0,22 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | € | 357 | 387 | 0,03 |
| **Goldman Sachs Asset Management CLO PLC** | | | | |
| 0,549 % fällig am 01.08.2022 | $ | 842 | 840 | 0,07 |
| **Hyundai Auto Lease Securitization Trust** | | | | |
| 0,380 % fällig am 15.06.2016 | | 1.083 | 1.083 | 0,10 |
| **Nautique Funding Ltd.** | | | | |
| 0,571 % fällig am 15.04.2020 | | 1.478 | 1.467 | 0,13 |
| **Nelnet Student Loan Trust** | | | | |
| 0,390 % fällig am 26.10.2020 | | 1.951 | 1.950 | 0,17 |
| 0,666 % fällig am 23.12.2019 | | 4.227 | 4.214 | 0,37 |
| **OHA Credit Partners VI Ltd.** | | | | |
| 1,582 % fällig am 15.05.2023 | | 3.864 | 3.845 | 0,34 |
| **Panhandle-Plains Higher Education Authority, Inc.** | | | | |
| 1,742 % fällig am 01.10.2035 | | 220 | 220 | 0,02 |
| **Primus Clo II Ltd.** | | | | |
| 0,521 % fällig am 15.07.2021 | | 2.433 | 2.397 | 0,21 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 15.06.2024 | | 1.589 | 1.570 | 0,14 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,132 % fällig am 15.12.2023 | € | 488 | 513 | 0,05 |
| 0,142 % fällig am 17.06.2024 | | 714 | 740 | 0,06 |
| 0,512 % fällig am 15.12.2027 | | 500 | 520 | 0,05 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | |
| 1,164 % fällig am 02.03.2020 | $ | 348 | 345 | 0,03 |
| 1,414 % fällig am 03.09.2024 | | 200 | 197 | 0,02 |
| **Symphony CLO VIII LP** | | | | |
| 1,419 % fällig am 09.01.2023 | | 3.229 | 3.214 | 0,28 |
| **Symphony CLO X Ltd.** | | | | |
| 1,586 % fällig am 23.07.2023 | $ | 1.300 | $ 1.298 | 0,11 |
| **Venture XI CLO Ltd.** | | | | |
| 1,662 % fällig am 14.11.2022 | | 4.500 | 4.472 | 0,39 |
| **Voya CLO II Ltd.** | | | | |
| 0,549 % fällig am 01.08.2020 | | 1.158 | 1.159 | 0,10 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 5.900 | 5.855 | 0,51 |
| | | | 50.409 | 4,42 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 75.640 | 17.148 | 1,51 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 2.460 | 537 | 0,05 |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,150 %) fällig am 02.09.2016 | CZK | 41.000 | 1.650 | 0,14 |
| (0,150 %) fällig am 30.09.2016 | | 279.000 | 11.230 | 0,99 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 0,563 % fällig am 28.01.2020 | $ | 10.000 | 9.850 | 0,86 |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,071 % fällig am 14.01.2017 | | 400 | 401 | 0,03 |
| 1,376 % fällig am 17.09.2016 | | 2.300 | 2.304 | 0,20 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,085 %) fällig am 29.02.2016 | JPY | 900.000 | 7.482 | 0,66 |
| (0,061 %) fällig am 07.03.2016 | | 2.770.000 | 23.028 | 2,02 |
| (0,027 %) fällig am 22.02.2016 | | 7.850.000 | 65.258 | 5,73 |
| (0,001 %) fällig am 08.02.2016 | | 10.000.000 | 83.131 | 7,30 |
| | | | 222.019 | 19,49 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 0,560 % fällig am 05.01.2016 | $ | 11.200 | 11.199 | 0,98 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 0,811 % fällig am 12.01.2016 | $ | 4.600 | $ 4.599 | 0,40 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 1,001 % fällig am 11.01.2016 | | 400 | 400 | 0,04 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 0,962 % fällig am 11.01.2016 | | 1.600 | 1.600 | 0,14 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 0,551 % fällig am 26.01.2016 | | 4.600 | 4.598 | 0,40 |
| **Hewlett-Packard Co.** | | | | |
| 0,701 % fällig am 08.01.2016 | | 1.200 | 1.200 | 0,11 |
| **Hitachi Capital America Corp.** | | | | |
| 0,720 % fällig am 04.01.2016 | | 7.800 | 7.800 | 0,68 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 0,511 % fällig am 13.01.2016 | | 2.000 | 2.000 | 0,18 |
| **Pitney Bowes, Inc.** | | | | |
| 1,051 % fällig am 12.01.2016 | | 3.000 | 2.999 | 0,26 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 0,651 % fällig am 05.01.2016 | | 2.400 | 2.400 | 0,21 |
| **Thomson Reuters Corp.** | | | | |
| 0,701 % fällig am 13.01.2016 | | 400 | 400 | 0,04 |
| | | | 39.195 | 3,44 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE** | | | | |
| **Nomura Securities International, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 04.01.2016 (Mit Datum vom 31.12.2015. Besichert durch US Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025 bewertet mit $7.872. Die Rückkauferlöse betragen $7.700.) | | 7.700 | 7.700 | 0,68 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 1.416.810** | **124,38** |

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 1.180 | $ (495) | (0,04) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 340 | (849) | (0,07) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Long | 03/2016 | 31 | 34 | 0,00 |
| S&P 500 E-mini Index March Futures | Long | 03/2016 | 11.151 | 5.963 | 0,52 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.219 | (212) | (0,02) |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 251 | 55 | 0,00 |
| | | | | $ 4.496 | 0,39 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 160,000 | 22.01.2016 | 180 | $ (120) | $ (37) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 4.459** | **0,39** |

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

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

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | $ 88.100 | $ (519) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 29.000 | (19) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | $ 401.800 | $ (9.001) | (0,79) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 23.400 | (432) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 1.600 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,840 % | 28.10.2025 | 13.100 | (65) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,050 % | 28.10.2025 | 6.100 | (86) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,215 % | 05.02.2026 | 4.500 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 96.900 | 325 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 13.700 | (296) | (0,03) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,810 % | 14.09.2046 | 9.600 | 166 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | £ 1.700 | (16) | 0,00 |
| | | | | | $ (9.937) | (0,87) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (9.937)** | **(0,87)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,358 % | 30.12.2016 | $ 137.100 | $ 370 | $ 359 | 0,03 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 % | 14.03.2016 | 60.600 | 758 | 981 | 0,09 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 1.240.600 | 1.203 | 23 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,350 % | 12.09.2016 | 19.400 | 532 | 217 | 0,02 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,750 % | 03.02.2016 | 31.000 | 56 | 3 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 % | 06.09.2016 | 123.200 | 891 | 477 | 0,04 |
| | | | | | | | $ 3.810 | $ 2.060 | 0,18 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 8.200 | $ (15) | $ (7) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 12.100 | (23) | (10) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | 1.900 | (4) | (2) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 4.100 | (9) | (3) | 0,00 |
| Call - CDX.IG-25 Index | GST | Kauf | 0,700 % | 20.01.2016 | 18.000 | (11) | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | GST | Verkauf | 0,900 % | 20.01.2016 | 18.000 | (34) | (27) | (0,01) |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 3.600 | (7) | (1) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 3.800 | (7) | (4) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 3.600 | (8) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (118) | $ (56) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | GLM | $ 1,111 | 07.01.2016 | € 21.659 | $ (146) | $ (3) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,800 | 27.01.2016 | $ 5.300 | (78) | (39) | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BOA | JPY 80,000 | 18.02.2019 | 200 | (11) | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (235) | $ (43) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 30.12.2016 | $ 30.200 | $ (371) | $ (392) | (0,03) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,610 % | 14.03.2016 | 60.600 | (303) | (215) | (0,02) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,855 % | 14.03.2016 | 60.600 | (455) | (511) | (0,05) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 12.09.2016 | 19.400 | (535) | (357) | (0,03) |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 03.02.2016 | 31.000 | (161) | (35) | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,272 % | 06.09.2016 | 28.000 | (890) | (531) | (0,05) |
| | | | | | | | $ (2.715) | $ (2.041) | (0,18) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | $ 900 | $ (10) | $ (11) | $ 1 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | FBF | 800 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2018 | MYC | 200 | (121) | (19) | (102) | (0,01) |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2016 | DUB | 300 | 2 | 4 | (2) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2016 | DUB | $ 200 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 1.400 | 3 | (27) | 30 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | DUB | 1.500 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | 1.600 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| Spain Government Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | MYC | 600 | 7 | 1 | 6 | 0,00 |
| US Treasury Notes | 0,250 % | 20.09.2016 | HUS | € 2.500 | 3 | (64) | 67 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 1.600 | (2) | (13) | 11 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BPS | 1.600 | (2) | (21) | 19 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | BPS | 400 | (3) | (8) | 5 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | BRC | 1.500 | (9) | (30) | 21 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | JPM | 300 | 0 | (2) | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (96) | $ (191) | $ 95 | (0,01) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month EURIBOR abzgl. 0,200 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 16.03.2026 | CBK | € 27.100 | $ 29.376 | $ 705 | $ 332 | $ 373 | 0,06 |

(1) Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,140 % | 14.01.2030 | GLM | £ 1.880 | $ 18 | $ 0 | $ 18 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | FBF | 300 | 15 | 2 | 13 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,450 % | 15.12.2044 | FBF | 100 | 5 | (1) | 6 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,530 % | 15.12.2044 | FBF | 200 | 21 | 2 | 19 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,530 % | 15.12.2044 | JPM | 100 | 11 | 1 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | $ 70 | $ 4 | $ 66 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 5.000 | $ | 1.942 | BPS | $ 678 | $ 0 | $ 678 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 1.280 | BRL | 5.000 | BPS | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | | 629 | | 2.500 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 2.500 | $ | 640 | CBK | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.500 | | 640 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 627 | BRL | 2.500 | MSB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 519 | CNH | 3.420 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.901 | € | 1.758 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 10.184 | $ | 11.090 | CBK | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.472 | € | 1.388 | HUS | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 12.355 | $ | 13.166 | HUS | 0 | (255) | (255) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 8.152 | € | 7.442 | JPM | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 9 | $ | 10 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 11.013 | € | 10.091 | UAG | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 14.536 | $ | 21.915 | MSB | 491 | 0 | 491 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 25.594 | £ | 17.298 | UAG | 0 | (99) | (99) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 2.762 | $ | 4.146 | UAG | 75 | 0 | 75 | 0,01 |
| 01/2016 | INR | 10.370 | | 156 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 14.858 | | 11.189 | MSB | 492 | 0 | 492 | 0,04 |
| 02/2016 | € | 2.250 | | 3.028 | DUB | 582 | 0 | 582 | 0,05 |
| 02/2016 | | 1.286 | | 1.402 | MSB | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.597 | | 9.397 | UAG | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.076 | £ | 721 | CBK | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 17.298 | $ | 25.596 | UAG | 98 | 0 | 98 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 3.390.000 | | 27.671 | BPS | 0 | (539) | (539) | (0,05) |
| 02/2016 | | 10.000.000 | | 82.832 | CBK | 0 | (360) | (360) | (0,03) |
| 02/2016 | | 900.000 | | 7.334 | CBK | 0 | (157) | (157) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ | 5.775 | JPY | 709.800 | CBK | $ 131 | $ 0 | $ 131 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 10.603.387 | $ | 86.168 | JPM | 0 | (2.050) | (2.050) | (0,18) |
| 02/2016 | | 670.000 | | 5.465 | JPM | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 80.687 | JPY | 9.921.900 | MSB | 1.862 | 0 | 1.862 | 0,16 |
| 02/2016 | JPY | 3.790.000 | $ | 30.857 | MSB | 0 | (682) | (682) | (0,06) |
| 02/2016 | NZD | 212 | | 138 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 03/2016 | JPY | 2.115.000 | | 17.256 | BOA | 0 | (350) | (350) | (0,03) |
| 03/2016 | | 655.000 | | 5.341 | BPS | 0 | (111) | (111) | (0,01) |
| 03/2016 | $ | 341 | MXN | 5.870 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 06/2016 | € | 3.222 | $ | 4.436 | BOA | 918 | 0 | 918 | 0,08 |
| 06/2016 | $ | 966 | € | 715 | BOA | 0 | (185) | (185) | (0,02) |
| 06/2016 | € | 14.489 | $ | 19.815 | BOA | 4.003 | 0 | 4.003 | 0,35 |
| 06/2016 | | 3.566 | | 4.903 | BRC | 1.010 | 0 | 1.010 | 0,09 |
| 06/2016 | $ | 2.179 | € | 1.612 | DUB | 0 | (419) | (419) | (0,04) |
| 06/2016 | € | 5.299 | $ | 7.255 | DUB | 1.472 | 0 | 1.472 | 0,13 |
| 06/2016 | | 4.771 | | 6.562 | MSB | 1.355 | 0 | 1.355 | 0,12 |
| 07/2016 | | 7.581 | | 10.284 | NAB | 1.997 | 0 | 1.997 | 0,18 |
| 09/2016 | CZK | 61.085 | | 2.554 | CBK | 70 | 0 | 70 | 0,01 |
| 09/2016 | | 196.515 | | 8.191 | HUS | 186 | 0 | 186 | 0,02 |
| 09/2016 | | 62.875 | | 2.620 | JPM | 59 | 0 | 59 | 0,01 |
| 10/2016 | BRL | 17.270 | | 4.149 | BPS | 167 | 0 | 167 | 0,02 |
| 10/2016 | | 18.110 | | 4.319 | CBK | 143 | 0 | 143 | 0,01 |
| 10/2016 | | 10.010 | | 2.456 | GLM | 148 | 0 | 148 | 0,01 |
| 10/2016 | | 23.600 | | 5.607 | JPM | 166 | 0 | 166 | 0,01 |
| 10/2016 | | 6.650 | | 1.629 | MSB | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| 10/2016 | CNH | 13.147 | | 2.019 | CBK | 76 | 0 | 76 | 0,01 |
| 10/2016 | $ | 699 | CNH | 4.627 | HUS | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 65.041 | $ | 10.054 | SCX | 438 | 0 | 438 | 0,04 |
| 01/2017 | BRL | 2.460 | | 583 | DUB | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | | | | | | $ 16.896 | $ (5.493) | $ 11.403 | 1,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 12.002** | **1,05** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae TBA (h)** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ (17.600) | $ (17.601) | (1,54) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | (21.000) | (21.623) | (1,90) |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | (15.000) | (15.874) | (1,39) |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | (23.200) | (24.505) | (2,15) |
| | | $ (79.603) | (6,98) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (79.603)** | **(6,98)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.343.731** | **117,97** |

| TAGESGELDEINLAGEN | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 3 | $ 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 13 | 19 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 107 | 107 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 55 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2.956 | 2.956 | 0,26 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 12 | 9 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 32 | 32 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 922 | 922 | 0,08 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 5 | 3 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 888 | 888 | 0,08 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2 | 2 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 425 | 306 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 299 | 325 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 4 | 6 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 23 | 0 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ 21 | $ 21 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | **$ 5.601** | **0,49** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | **$ (210.262)** | **(18,46)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.139.070** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

**(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(b) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 11.508 und Barmittel in Höhe von USD 2.308 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 55.247 und Barmittel in Höhe von USD 1.240 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 283.480 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 70.985 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**(f) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 2.160 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(h) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(i) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 1.409.175 | $ 7.635 | $ 1.416.810 |
| Finanzderivate[3] | 4.459 | 2.065 | 0 | 6.524 |
| Leerverkäufe | 0 | (79.603) | 0 | (79.603) |
| **Summen** | **$ 4.459** | **$ 1.331.637** | **$ 7.635** | **$ 1.343.731** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 136.896 | $ 1.122.889 | $ 5.595 | $ 1.265.380 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 26.810 | 0 | 26.810 |
| Finanzderivate[3] | 28.387 | 11.507 | 0 | 39.894 |
| **Summen** | **$ 165.283** | **$ 1.161.206** | **$ 5.595** | **$ 1.332.084** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutionell EUR (Hegend) Class und Class T EUR (Hegend) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 10.243 | $ 11.254 | BOA | $ 128 | $ 0 | $ 128 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 17.107 | € 16.045 | BOA | 323 | 0 | 323 | 0,03 |
| 01/2016 | 130 | 122 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | € 308 | $ 338 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | 371 | 403 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 406 | € 381 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | € 21.488 | $ 23.539 | CBK | 201 | (6) | 195 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 168 | € 157 | DUB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | € 1.621 | $ 1.782 | HUS | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 17.106 | € 16.052 | HUS | 331 | 0 | 331 | 0,03 |
| 01/2016 | 37 | 35 | NAB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € 13 | $ 14 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 2 | € 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € 103 | $ 113 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | 15.109 | 16.501 | UAG | 90 | (1) | 89 | 0,01 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 17.077 | € 16.069 | UAG | $ 379 | $ 0 | $ 379 | 0,03 |
| 02/2016 | 11.257 | 10.238 | BOA | 0 | (128) | (128) | (0,01) |
| 02/2016 | 1.783 | 1.621 | HUS | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | € 2 | $ 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 16.434 | € 15.035 | UAG | 0 | (90) | (90) | (0,01) |
| | | | | $ 1.490 | $ (246) | $ 1.244 | 0,11 |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) and Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 12.750 | $ 13.915 | $ (53) | $ 0 | $ (53) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOM | 0,450 % | 06.11.2015 | 05.02.2016 | $ 26.298 | $ (26.298) | (2,31) |
| BOS | (0,200 %) | 23.11.2015 | 04.01.2016 | 28.600 | (28.594) | (2,51) |
| BOS | 0,220 % | 18.11.2015 | 15.01.2016 | 25.564 | (25.564) | (2,24) |
| BOS | 0,900 % | 02.12.2015 | 04.01.2016 | 28.628 | (28.650) | (2,52) |
| BSN | 0,470 % | 24.11.2015 | 11.01.2016 | 24.688 | (24.687) | (2,17) |
| BSN | 0,500 % | 24.11.2015 | 12.01.2016 | 14.813 | (14.812) | (1,30) |
| GRE | 0,600 % | 25.11.2015 | 20.01.2016 | 19.429 | (19.428) | (1,71) |
| GRE | 0,640 % | 23.11.2015 | 04.01.2016 | 5.728 | (5.727) | (0,50) |
| IND | 0,550 % | 07.12.2015 | 19.01.2016 | 15.326 | (15.326) | (1,35) |
| IND | 0,590 % | 09.12.2015 | 20.01.2016 | 79.866 | (79.866) | (7,01) |
| RDR | 0,560 % | 16.12.2015 | 20.01.2016 | 15.094 | (15.094) | (1,32) |
| | | | | | $ (284.046) | (24,94) |

**(m) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GSC | 0,496 % | 16.11.2015 | 15.01.2016 | $ 57.366 | $ (57.437) | (5,04) |
| MSC | 0,608 % | 19.11.2015 | 19.01.2016 | 10.661 | (10.680) | (0,94) |
| NOM | (0,101 %) | 04.12.2015 | 15.01.2016 | 3.375 | (3.378) | (0,30) |
| | | | | | $ (71.495) | (6,28) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 36 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(n) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 4.685 | $ (4.670) | $ 15 |
| BPS | 178 | (200) | (22) |
| BRC | 989 | (970) | 19 |
| CBK | 808 | (440) | 368 |
| DUB | 1.947 | (2.010) | (63) |
| FBF | 1 | (50) | (49) |
| GLM | 133 | (610) | (477) |
| GST | (8) | 0 | (8) |
| HUS | 286 | (330) | (44) |
| JPM | (2.146) | 2.160 | 14 |
| MSB | 3.631 | (3.370) | 261 |
| MYC | (200) | (110) | (310) |
| NAB | 1.998 | (1.990) | 8 |
| SCX | 439 | (250) | 189 |
| UAG | 452 | (410) | 42 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(o) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 124,38 | 96,63 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,39 | 2,17 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,87) | (0,28) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 1,05 | 1,16 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (6,98) | 0,00 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 2,04 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des StocksPLUS™ Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ | 224.400 | $ 220.025 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 31.07.2020 | | 122.000 | 123.192 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 65.700 | 91.420 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,009 % fällig am 06.07.2015 | JPY | 10.530.000 | 87.935 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,001)% fällig am 08.02.2016 | | 10.000.000 | 82.867 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,002)% fällig am 19.10.2015 | | 10.210.000 | 82.362 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.06.2015 | | 8.080.000 | 67.238 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,027)% fällig am 22.02.2016 | | 7.850.000 | 63.868 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | $ | 63.600 | 62.715 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 56.003 | 56.044 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 43.500 | 43.931 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 27.01.2015 | | 42.100 | 42.100 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 42.191 | 41.894 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 36.800 | 36.524 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 3.634.027 | 36.367 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 33.000 | 33.491 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | | 31.600 | 31.467 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | € | 22.600 | 26.742 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,022)% fällig am 21.12.2015 | JPY | 2.880.000 | 23.822 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 24.09.2015 | | 2.880.000 | 23.417 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 11.395.790 | $ 114.040 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 65.700 | 90.835 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.10.2021 | $ | 65.700 | 65.266 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 468.000 | 47.287 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,050 % fällig am 12.02.2015 | $ | 37.500 | 37.498 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 38.100 | 36.953 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 31.12.2021 | | 33.000 | 32.979 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,070 % fällig am 09.04.2015 | | 31.700 | 31.699 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 30.400 | 30.319 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | € | 22.600 | 27.476 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 25.733 | 26.200 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,082 % fällig am 23.01.2015 | | 26.000 | 26.000 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,022)% fällig am 21.12.2015 | JPY | 2.880.000 | 23.353 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 20.982 | 21.007 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2015 | BRL | 56.000 | 18.852 |
| **Japan Government International Bond** | | | |
| 1,500 % fällig am 20.12.2044 | JPY | 2.210.000 | 18.787 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,070 % fällig am 07.04.2015 | | $ 15.900 | 15.900 |
| **Japan Government International Bond** | | | |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | JPY | 1.810.000 | 15.801 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2030 | | € 12.200 | 15.747 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,070 % fällig am 07.08.2015 | | $ 14.000 | 13.999 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,070 % fällig am 27.04.2015 | | 13.700 | 13.700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,150 % fällig am 09.04.2015 | | 13.400 | 13.400 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 41.000 | 12.959 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Short-Term Fund (a)** | | 1.207.558 | 12.100 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | $ | 12.021 | 11.839 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.12.2015 | JPY | 1.460.000 | 11.825 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,060 % fällig am 14.05.2015 | $ | 11.485 | 11.485 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,074 % fällig am 12.08.2015 | | 10.300 | 10.299 |

(a) Der StocksPLUS™ Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Albertson's LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.08.2021 | $ | 23 | $ 23 | 0,01 |
| **Crown Castle Operating Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2021 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **DaVita HealthCare Partners, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.06.2021 | | 99 | 98 | 0,05 |
| **Delos Finance Sarl** | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.03.2021 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Endo Luxembourg Finance I Co. Sarl** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.09.2022 | | 15 | 15 | 0,01 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | | 2.843 | 2.838 | 1,57 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,174 % fällig am 31.03.2017 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 3,357 % fällig am 01.05.2018 | | 12 | 12 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 322 | 321 | 0,18 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 7,174 % fällig am 30.01.2019 | | 351 | 247 | 0,14 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.12.2019 | | 267 | 264 | 0,15 |
| **Seadrill Operating LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.02.2021 | | 24 | 10 | 0,01 |
| **Sequa Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 19.06.2017 | | 223 | 155 | 0,09 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.11.2022 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2020 | | 401 | 394 | 0,22 |
| | | | 4.402 | 2,44 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2017 | $ | 40 | 40 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | | 90 | 90 | 0,05 |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 180 | 180 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | | 475 | 490 | 0,27 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2017 | | 540 | 568 | 0,31 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 213 | 0,12 |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 200 | 215 | 0,12 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 | € | 100 | 16 | 0,01 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 600 | 614 | 0,34 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 300 | 306 | 0,17 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.08.2025 | $ | 70 | 71 | 0,04 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 400 | 441 | 0,24 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 1.700 | 2.511 | 1,39 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.05.2017 | $ | 40 | 41 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 247 | 256 | 0,14 |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | | 560 | 578 | 0,32 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 100 | 145 | 0,08 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 470 | 515 | 0,29 |
| **Jefferies LoanCore LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ | 200 | 192 | 0,11 |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 200 | 219 | 0,12 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 265 | 410 | 0,23 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 1.000 | 1.564 | 0,86 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2019 | $ | 100 | 94 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.08.2033 | | 550 | 371 | 0,21 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 159 | $ 21 | 0,01 |
| **Novo Banco S.A.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 04.04.2019 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 23.04.2019 | | 46 | 44 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 14.05.2019 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 556 | 75 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 1.580 | 220 | 0,13 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.12.2021 | $ | 219 | 220 | 0,12 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 524 | 73 | 0,04 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | $ | 200 | 204 | 0,11 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 900 | 962 | 0,53 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | $ | 200 | 201 | 0,11 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | | 400 | 415 | 0,23 |
| **TIG FINCO PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 02.03.2020 | £ | 12 | 18 | 0,01 |
| 8,750 % fällig am 02.04.2020 | | 59 | 78 | 0,04 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | $ | 250 | 285 | 0,16 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.500 | 1.714 | 0,95 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | $ | 25 | 25 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 50 | 50 | 0,03 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | |
| 5,942 % fällig am 21.11.2023 | | 200 | 187 | 0,10 |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | | 100 | 102 | 0,06 |
| | | | 15.037 | 8,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Athens Urban Transportation Organisation** | | | | |
| 4,851 % fällig am 19.09.2016 | € | 155 | 157 | 0,09 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.10.2019 (a) | $ | 120 | 75 | 0,04 |
| **Caesars Entertainment Operating Co., Inc. (b)** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2020 | | 712 | 545 | 0,30 |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 | | 167 | 128 | 0,07 |
| 11,250 % fällig am 01.06.2017 | | 841 | 635 | 0,35 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | | 17 | 6 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 15 | 5 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 7 | 2 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 101 | 53 | 0,03 |
| **CCO Safari II LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 23 | 23 | 0,01 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 35 | 35 | 0,02 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 52 | 52 | 0,03 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 11 | 11 | 0,01 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 3,571 % fällig am 15.04.2019 | | 22 | 6 | 0,00 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 40 | 40 | 0,02 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 34 | 34 | 0,02 |
| **Hellenic Railways Organization S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 400 | 3 | 0,00 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2019 | $ | 133 | 98 | 0,05 |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | | 146 | 102 | 0,06 |
| 9,000 % fällig am 15.09.2022 | | 360 | 250 | 0,14 |
| **Intrepid Aviation Group Holdings LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2019 | | 82 | 68 | 0,04 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.11.2016 | | 50 | 53 | 0,03 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | | 290 | 288 | 0,16 |
| **Perstorp Holding AB** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.05.2017 | | 200 | 199 | 0,11 |
| **Spanish Broadcasting System, Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 15.04.2017 | | 120 | 118 | 0,07 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | £ | 1 | $ 1 | 0,00 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | $ | 54 | 66 | 0,04 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 41 | 60 | 0,03 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | $ | 130 | 116 | 0,07 |
| | | | 3.229 | 1,79 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 400 | 378 | 0,21 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 06.02.2028 | | 200 | 170 | 0,09 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 702 | 709 | 0,39 |
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | | 8 | 8 | 0,01 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 6 | 7 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 23.04.2019 | | 1.600 | 1.791 | 0,99 |
| **Illinois Power Generating Co.** | | | | |
| 6,300 % fällig am 01.04.2020 | | 140 | 85 | 0,05 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | | 182 | 180 | 0,10 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | | 6 | 5 | 0,00 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 203 | 186 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2019 | | 5 | 4 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 17.03.2017 | | 17 | 16 | 0,01 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | | 112 | 80 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 25 | 23 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | | 185 | 122 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 17.03.2020 | | 278 | 209 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 27.01.2021 | | 45 | 34 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 100 | 96 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 27.01.2041 | $ | 54 | 35 | 0,02 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 1.235 | 806 | 0,45 |
| 6,875 % fällig am 20.01.2040 | | 29 | 19 | 0,01 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.03.2017 | | 40 | 41 | 0,02 |
| | | | 5.012 | 2,77 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | | 23.278 | 12,87 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cook County, Illinois, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | | 30 | 31 | 0,02 |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2015** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | | 20 | 21 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | | 40 | 41 | 0,02 |
| | | | 93 | 0,05 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2045 - 01.12.2045 | | 3.000 | 3.003 | 1,66 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2045 | | 1.000 | 1.033 | 0,57 |
| 4,422 % fällig am 25.05.2025 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 7,228 % fällig am 25.07.2033 (c) | | 218 | 47 | 0,03 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 0,120 % fällig am 14.01.2016 | | 400 | 400 | 0,22 |
| 0,225 % fällig am 03.02.2016 | | 900 | 900 | 0,50 |
| 0,231 % fällig am 27.01.2016 | | 1.100 | 1.100 | 0,61 |
| 0,248 % fällig am 10.02.2016 | | 1.100 | 1.100 | 0,61 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 800 | 800 | 0,44 |
| 0,255 % fällig am 29.01.2016 | | 2.900 | 2.900 | 1,60 |
| 0,310 % fällig am 26.01.2016 - 01.02.2016 | | 1.200 | 1.200 | 0,66 |
| 0,330 % fällig am 26.02.2016 | | 2.300 | 2.299 | 1,27 |
| 0,340 % fällig am 02.02.2016 | | 1.100 | 1.100 | 0,61 |
| 0,380 % fällig am 09.02.2016 | | 500 | 500 | 0,28 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 6,220 % fällig am 15.06.2042 (c) | | 165 | 44 | 0,02 |
| | | | 16.435 | 9,08 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Strategic Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ | 1.481 | $ 1.462 | 0,81 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 0,428 % fällig am 31.10.2017 | | 19 | 19 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 4.330 | 4.321 | 2,39 |
| | | | 5.802 | 3,21 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,577 % fällig am 25.08.2036 | | 189 | 158 | 0,09 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,422 % fällig am 25.03.2035 (b) | | 600 | 554 | 0,31 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,722 % fällig am 25.10.2035 (b) | | 848 | 688 | 0,38 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc.** | | | | |
| 2,222 % fällig am 25.02.2034 | | 204 | 193 | 0,11 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.08.2033 | | 1.058 | 1.026 | 0,57 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 4,725 % fällig am 20.05.2036 (b) | | 127 | 108 | 0,06 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 25.04.2036 | | 1.400 | 1.259 | 0,69 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,897 % fällig am 26.07.2036 | | 179 | 179 | 0,10 |
| 2,952 % fällig am 26.03.2036 | | 56 | 55 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 26.02.2037 | | 1.106 | 1.101 | 0,61 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,842 % fällig am 25.10.2035 | | 211 | 212 | 0,12 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | | 1.531 | 1.465 | 0,81 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 11.11.2035 (b) | | 41 | 41 | 0,02 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,472 % fällig am 25.01.2034 | | 2.079 | 1.893 | 1,05 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust (b)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | | 765 | 684 | 0,38 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,882 % fällig am 25.05.2046 | | 3.235 | 3.149 | 1,74 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 (b) | | 198 | 186 | 0,10 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | | |
| 0,551 % fällig am 27.12.2035 | | 1.025 | 941 | 0,52 |
| 5,467 % fällig am 16.09.2039 | | 190 | 192 | 0,11 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 4,002 % fällig am 25.01.2037 (b) | | 246 | 132 | 0,07 |
| **CWABS Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.05.2036 | | 1.156 | 1.099 | 0,61 |
| **CWABS, Inc. Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,997 % fällig am 25.05.2034 | | 1.556 | 1.325 | 0,73 |
| **EMF-NL** | | | | |
| 0,948 % fällig am 17.07.2041 | € | 48 | 51 | 0,03 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.11.2036 | $ | 2.976 | 1.654 | 0,91 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.01.2036 | | 100 | 90 | 0,05 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 2.243 | 1.172 | 0,65 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2036 | | 1.968 | 1.678 | 0,93 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | |
| 0,319 % fällig am 28.08.2039 | € | 545 | 433 | 0,24 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,852 % fällig am 25.03.2037 (b) | $ | 169 | 152 | 0,08 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | £ | 32 | 47 | 0,03 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 | $ | 280 | 184 | 0,10 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,229 % fällig am 25.04.2037 | | 213 | 162 | 0,09 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 1,082 % fällig am 25.09.2035 | | 2.000 | 1.862 | 1,03 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | | 2.121 | 2.011 | 1,11 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2037 | | 1.000 | 926 | 0,51 |
| **JPMorgan Mortgage Trust (b)** | | | | |
| 2,593 % fällig am 25.08.2036 | $ | 187 | $ 163 | 0,09 |
| 2,654 % fällig am 25.01.2037 | | 478 | 436 | 0,24 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 6,612 % fällig am 15.06.2036 | | 465 | 465 | 0,26 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 (b) | | 80 | 66 | 0,04 |
| 1,222 % fällig am 25.10.2035 | | 601 | 564 | 0,31 |
| **Leo-Mesdag BV** | | | | |
| 0,271 % fällig am 29.08.2019 | € | 204 | 218 | 0,12 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,147 % fällig am 25.06.2034 | $ | 1.016 | 964 | 0,53 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.06.2036 | | 698 | 460 | 0,25 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital I Trust** | | | | |
| 7,490 % fällig am 15.07.2033 | | 100 | 110 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.04.2035 | | 711 | 667 | 0,37 |
| 0,702 % fällig am 25.11.2035 | | 243 | 236 | 0,13 |
| **Nationslink Funding Corporation Commercial Loan Pass-Through Certificates** | | | | |
| 6,450 % fällig am 22.01.2026 | | 130 | 139 | 0,08 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,202 % fällig am 25.03.2035 | | 84 | 68 | 0,04 |
| 2,447 % fällig am 25.05.2034 (b) | | 2.018 | 1.816 | 1,00 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.09.2034 | | 439 | 378 | 0,21 |
| **RBSCF Trust** | | | | |
| 5,420 % fällig am 16.01.2049 | | 174 | 176 | 0,10 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 (b) | | 220 | 199 | 0,11 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 4,934 % fällig am 25.08.2035 | | 108 | 109 | 0,06 |
| **Residential Accredit Loan, Inc. Trust** | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.06.2037 | | 173 | 128 | 0,07 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.03.2036 | | 2.000 | 1.554 | 0,86 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.09.2035 | | 300 | 278 | 0,15 |
| **Sandwell Commercial Finance No.2 PLC** | | | | |
| 1,690 % fällig am 30.09.2037 | £ | 33 | 30 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,685 % fällig am 25.05.2035 (b) | $ | 463 | 324 | 0,18 |
| 2,877 % fällig am 25.09.2035 | | 204 | 174 | 0,10 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 1,202 % fällig am 25.07.2035 | | 290 | 261 | 0,14 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | | 889 | 790 | 0,44 |
| 0,832 % fällig am 25.05.2035 | | 104 | 104 | 0,06 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 100 | 146 | 0,08 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,151 % fällig am 25.08.2046 | $ | 2.039 | 1.835 | 1,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.05.2035 (b) | | 1.010 | 799 | 0,44 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037 (b) | | 1.731 | 1.598 | 0,88 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,723 % fällig am 25.10.2036 (b) | | 104 | 97 | 0,05 |
| | | | 42.414 | 23,45 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Clavos Euro CDO Ltd.** | | | | |
| 4,148 % fällig am 18.04.2023 | € | 1.000 | 1.095 | 0,60 |
| **Diversified Asset Securitization Holdings II LP** | | | | |
| 1,002 % fällig am 15.09.2035 | $ | 696 | 684 | 0,38 |
| **Egret Funding CLO I PLC** | | | | |
| 0,409 % fällig am 20.12.2022 | € | 127 | 138 | 0,08 |
| **Eurocredit CDO V PLC** | | | | |
| 0,428 % fällig am 12.09.2022 | | 1.350 | 1.467 | 0,81 |
| **Harbourmaster CLO 6 BV** | | | | |
| 0,367 % fällig am 25.10.2020 | | 97 | 105 | 0,06 |
| **Harbourmaster CLO 7 BV** | | | | |
| 0,269 % fällig am 22.09.2022 | € | 100 | $ 107 | 0,06 |
| **Harbourmaster Pro-Rata CLO 2 BV** | | | | |
| 0,311 % fällig am 15.10.2022 | | 2.300 | 2.384 | 1,32 |
| **Pangaea ABS SPV** | | | | |
| 0,129 % fällig am 28.12.2096 | | 59 | 62 | 0,03 |
| **RMF Euro CDO IV PLC** | | | | |
| 0,438 % fällig am 11.09.2022 | | 130 | 141 | 0,08 |
| **Skellig Rock BV** | | | | |
| 0,511 % fällig am 30.11.2022 | | 1.900 | 2.039 | 1,13 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,410 % fällig am 26.01.2026 | $ | 1.300 | 1.244 | 0,69 |
| **South Coast Funding V** | | | | |
| 0,987 % fällig am 06.08.2039 | | 324 | 317 | 0,17 |
| **Stichting Halcyon Structured Asset Management European CLO** | | | | |
| 0,469 % fällig am 24.07.2023 | € | 4.992 | 5.251 | 2,90 |
| | | | 15.034 | 8,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 500 | 118 | 0,07 |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | | 500 | 113 | 0,06 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B (d)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2045 | | 229 | 137 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 15.08.2050 | | 1.855 | 1.133 | 0,63 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | | 34 | 7 | 0,00 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 5.195 | 939 | 0,52 |
| **Corporation Andina de Fomento** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 | MXN | 1.346 | 78 | 0,04 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 24.02.2023 | € | 4 | 3 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2024 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2025 | | 4 | 3 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2026 | | 14 | 10 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2027 | | 54 | 40 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2028 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2029 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2030 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2031 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2032 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2033 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2034 | | 54 | 35 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2035 | | 13 | 8 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2036 | | 13 | 8 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2037 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2038 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2039 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2040 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2041 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 24.02.2042 | | 3 | 2 | 0,00 |
| 3,800 % fällig am 08.08.2017 | JPY | 4.000 | 30 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 22.08.2016 | | 1.600 | 13 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.02.2016 | | 700 | 6 | 0,00 |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,061 %) fällig am 14.03.2016 | | 330.000 | 2.743 | 1,51 |
| (0,042 %) fällig am 07.03.2016 | | 270.000 | 2.245 | 1,24 |
| (0,040 %) fällig am 07.04.2016 | | 840.000 | 6.983 | 3,86 |
| | | | 14.678 | 8,11 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| **Bridgestone Corp.** | 27.801 | 953 | 0,53 |
| **Comcast Corp.** | 8.360 | 472 | 0,26 |
| **G8 Education Ltd.** | 412.168 | 1.064 | 0,59 |
| **General Motors Co.** | 47.561 | 1.617 | 0,89 |
| **Kohl's Corp.** | 16.889 | 804 | 0,44 |
| **Macy's, Inc.** | 22.555 | 789 | 0,44 |
| **OPAP S.A.** | 80.741 | 708 | 0,39 |
| **SeaWorld Entertainment, Inc.** | 31.952 | 629 | 0,35 |
| | | 7.036 | 3,89 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 32.284 | $ 932 | 0,51 |
| Coca-Cola Femsa SAB de C.V. | 51.042 | 364 | 0,20 |
| Ebro Foods S.A. | 52.945 | 1.041 | 0,57 |
| Imperial Tobacco Group PLC | 12.080 | 638 | 0,35 |
| Magnit PJSC | 6.913 | 278 | 0,15 |
| | | 3.253 | 1,78 |
| **ENERGY** | | | |
| Golar LNG Partners LP | 51.569 | 690 | 0,38 |
| Schlumberger Ltd. | 17.673 | 1.233 | 0,68 |
| | | 1.923 | 1,06 |
| **FINANCIALS** | | | |
| Aegon NV | 332.247 | 1.878 | 1,04 |
| Eurobank Ergasias S.A. | 712.189 | 798 | 0,44 |
| HSBC Holdings PLC | 276.775 | 2.184 | 1,21 |
| ICAP PLC | 126.340 | 948 | 0,52 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 587.558 | 1.950 | 1,08 |
| Lloyds Banking Group PLC | 1.747.155 | 1.880 | 1,04 |
| Navient Corp. | 52.571 | 602 | 0,33 |
| NN Group NV | 27.028 | 953 | 0,52 |
| Outfront Media, Inc. | 42.733 | 933 | 0,52 |
| Prudential Financial, Inc. | 15.474 | 1.260 | 0,70 |
| Towergate Finance PLC (j) | 10.233 | 11 | 0,01 |
| | | 13.397 | 7,41 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AbbVie, Inc. | 32.777 | 1.942 | 1,07 |
| Merck & Co., Inc. | 23.735 | 1.254 | 0,69 |
| Pfizer, Inc. | 58.741 | 1.896 | 1,05 |
| Qualicorp S.A. | 82.695 | 294 | 0,16 |
| Roche Holding AG | 7.217 | 2.001 | 1,10 |
| Sonic Healthcare Ltd. | 86.611 | 1.120 | 0,62 |
| | | 8.507 | 4,69 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Arteris S.A. | 127.100 | $ 310 | 0,17 |
| RR Donnelley & Sons Co. | 83.337 | 1.227 | 0,68 |
| Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA | 61.928 | 658 | 0,36 |
| Spotless Group Holdings Ltd. | 1.647.997 | 1.289 | 0,71 |
| | | 3.484 | 1,92 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Cisco Systems, Inc. | 58.319 | 1.583 | 0,88 |
| QUALCOMM, Inc. | 51.561 | 2.577 | 1,42 |
| Symantec Corp. | 52.059 | 1.093 | 0,60 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. | 291.702 | 1.258 | 0,70 |
| Western Digital Corp. | 20.036 | 1.203 | 0,67 |
| | | 7.714 | 4,27 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Covestro AG | 19.582 | 716 | 0,40 |
| International Paper Co. | 41.453 | 1.563 | 0,86 |
| | | 2.279 | 1,26 |
| **TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 75.064 | 2.583 | 1,43 |
| CenturyLink, Inc. | 49.551 | 1.247 | 0,69 |
| China Mobile Ltd. | 141.011 | 1.587 | 0,88 |
| PCCW Ltd. | 554.228 | 324 | 0,18 |
| Total Access Communication PCL | 308.047 | 257 | 0,14 |
| Vodafone Group PLC | 710.883 | 2.305 | 1,27 |
| | | 8.303 | 4,59 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Capital Power Corp. | 84.562 | 1.082 | 0,60 |
| Engie S.A. | 73.655 | 1.304 | 0,72 |
| Light S.A. | 120.473 | 301 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| PG&E Corp. | 47.364 | $ 2.519 | 1,39 |
| | | 5.206 | 2,88 |
| Summe Stammaktien | | 61.102 | 33,75 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| Hitachi Capital America Corp. 0,951 % fällig am 07.01.2016 | $ 1.000 | 1.000 | 0,55 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **REAL ESTATE INVESTMENT TRUSTS** | | | |
| Colony Capital, Inc. | 110.123 | 2.145 | 1,18 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (e)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 14.552 | 146 | 0,08 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 186.529** | **103,08** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2016 | 47 | $ (6) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ (6) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (6)** | **0,00** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | $ 1.940 | $ (44) | (0,02) |
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | 5.346 | (15) | (0,01) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 6.600 | (3) | 0,00 |
| | | | | $ (62) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 17.06.2025 | $ 16.940 | $ 24 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 4.490 | (215) | (0,12) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Strategic Income Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,000 % | 17.12.2019 | AUD 400 | $ 0 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,250 % | 15.03.2023 | 410 | 37 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,750 % | 18.06.2024 | 400 | 12 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,250 % | 17.12.2024 | 1.600 | 20 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 4,250 % | 17.12.2024 | 650 | 29 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month Australian Bank Bill | 3,500 % | 17.06.2025 | 8.800 | (6) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,270 % | 05.02.2020 | MXN 2.000 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,145 % | 02.04.2020 | 900 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,430 % | 17.11.2021 | 2.900 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,810 % | 02.05.2022 | 1.200 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,850 % | 02.05.2022 | 4.900 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,780 % | 29.09.2022 | 12.930 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,980 % | 26.08.2024 | 500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,710 % | 20.09.2029 | 500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,620 % | 18.02.2030 | 600 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (101) | (0,06) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (163)** | **(0,09)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | DUB | JPY 30,000 | 22.09.2016 | BRL 80 | $ (1) | $ (3) | 0,00 |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | JPM | 30,000 | 22.09.2016 | 210 | (3) | (7) | 0,00 |
| Put - OTC Brazilian real versus Japanese yen | MSB | 30,000 | 22.09.2016 | 110 | (1) | (3) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | BRL 3,905 | 31.03.2016 | $ 400 | (12) | (27) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | MSB | 3,950 | 14.04.2016 | 500 | (15) | (33) | (0,02) |
| | | | | | $ (32) | $ (73) | (0,04) |

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

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2018 | BOA | $ 10 | $ (6) | $ (4) | $ (2) | 0,00 |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.09.2020 | GST | 100 | (70) | (21) | (49) | (0,04) |
| Chesapeake Energy Corp. | 5,000 % | 20.12.2017 | MYC | 10 | (5) | (3) | (2) | 0,00 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 % | 20.03.2016 | JPM | 500 | (1) | (46) | 45 | 0,00 |
| Greece Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 38 | (6) | (3) | (3) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | BPS | 5 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | BRC | 15 | (4) | (1) | (3) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | HUS | 175 | (48) | (16) | (32) | (0,03) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 20 | (6) | (3) | (3) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.12.2019 | JPM | 250 | (69) | (22) | (47) | (0,04) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 50 | (5) | (4) | (1) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 50 | (5) | (4) | (1) | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 300 | (27) | (22) | (5) | (0,02) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | GST | 900 | (71) | (105) | 34 | (0,04) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | HUS | 140 | (8) | (6) | (2) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | 80 | (7) | (6) | (1) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | HUS | 140 | (23) | (15) | (8) | (0,01) |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2024 | HUS | 4 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 600 | (55) | (48) | (7) | (0,03) |
| | | | | | $ (418) | $ (330) | $ (88) | (0,23) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(1)**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ABX.HE.AAA Index | 0,110 % | 25.05.2046 | BOA | $ 1.122 | $ (215) | $ (221) | $ 6 | (0,12) |
| ABX.HE.AAA Index | 0,110 % | 25.05.2046 | MYC | 1.640 | (314) | (321) | 7 | (0,17) |
| CMBX.AAA-3 Index | 0,080 % | 13.12.2049 | MYC | 181 | (1) | (1) | 0 | 0,00 |
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | FBF | 900 | (21) | (14) | (7) | (0,01) |

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CMBX.AAA-6 Index | 0,500 % | 11.05.2063 | MYC | $ 2.000 | $ (45) | $ (45) | $ 0 | (0,02) |
| CMBX.AAA-7 Index | 0,500 % | 17.01.2047 | FBF | 900 | (32) | (23) | (9) | (0,02) |
| CMBX.AAA-7 Index | 0,500 % | 17.01.2047 | GST | 2.000 | (70) | (67) | (3) | (0,04) |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | FBF | 100 | (5) | (6) | 1 | 0,00 |
| CMBX.AAA-8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | MEI | 200 | (10) | (12) | 2 | (0,01) |
| | | | | | $ (713) | $ (710) | $ (3) | (0,39) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,000 % | 04.01.2021 | BPS | BRL 900 | $ (28) | $ (1) | $ (27) | (0,02) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | 200 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BPS | 8.700 | (242) | (5) | (237) | (0,13) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | CBK | 200 | (6) | (1) | (5) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | DUB | 9.200 | (256) | 12 | (268) | (0,14) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | FBF | 200 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | GLM | 200 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 600 | (17) | (1) | (16) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 390 | (10) | (1) | (9) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | FBF | 490 | (12) | 0 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | MYC | 490 | (12) | 0 | (12) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | BPS | 2.400 | (12) | (1) | (11) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,590 % | 04.01.2021 | MYC | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 16,400 % | 04.01.2021 | GLM | 890 | 0 | (1) | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ (610) | $ 1 | $ (611) | (0,34) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 6.022 | $ | 1.537 | BOA | $ 15 | $ 0 | $ 15 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.510 | BRL | 6.022 | BOA | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| 01/2016 | | 423 | | 1.653 | BPS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 1.653 | $ | 420 | BPS | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.609 | | 3.313 | DUB | 126 | 0 | 126 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 3.220 | BRL | 12.609 | DUB | 0 | (33) | (33) | (0,02) |
| 01/2016 | | 1.945 | € | 1.834 | AZD | 47 | 0 | 47 | 0,03 |
| 01/2016 | | 155 | | 146 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 67 | $ | 73 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 32.612 | | 34.771 | BOA | 0 | (656) | (656) | (0,36) |
| 01/2016 | $ | 2.050 | € | 1.933 | CBK | 49 | 0 | 49 | 0,03 |
| 01/2016 | | 4.224 | | 3.974 | FBF | 93 | 0 | 93 | 0,05 |
| 01/2016 | € | 1.996 | $ | 2.125 | MSB | 0 | (43) | (43) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 13 | € | 12 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 10 | $ | 11 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 452 | € | 415 | SCX | 3 | (4) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 28.734 | | 26.306 | UAG | 0 | (158) | (158) | (0,09) |
| 01/2016 | £ | 3.086 | $ | 4.653 | MSB | 104 | 0 | 104 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 4.569 | £ | 3.086 | MSB | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| 01/2016 | JPY | 198.558 | $ | 1.618 | BOA | 0 | (32) | (32) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 1.316 | JPY | 159.344 | MSB | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | | 325 | | 39.213 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 2.008 | $ | 1.411 | CBK | 0 | (48) | (48) | (0,03) |
| 02/2016 | $ | 159 | AUD | 220 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 6.022 | $ | 1.495 | BOA | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 228 | BRL | 930 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 9.983 | $ | 2.523 | DUB | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| 02/2016 | DKK | 2.700 | | 389 | UAG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 917 | € | 841 | CBK | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 26.306 | $ | 28.755 | UAG | 158 | 0 | 158 | 0,09 |
| 02/2016 | £ | 3.320 | | 5.040 | BOA | 146 | 0 | 146 | 0,08 |
| 02/2016 | | 172 | | 259 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.086 | | 4.569 | MSB | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 7.807 | JPY | 940.000 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| 02/2016 | JPY | 383.900 | $ | 3.125 | MSB | 0 | (69) | (69) | (0,04) |
| 02/2016 | | 159.344 | | 1.317 | MSB | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.366 | | 76 | SCX | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 03/2016 | | 270.000 | | 2.214 | BOA | 0 | (34) | (34) | (0,02) |
| 03/2016 | | 330.000 | | 2.684 | BPS | 0 | (64) | (64) | (0,04) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 03/2016 | MXN 1.356 | $ 78 | DUB | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 593 | RUB 41.990 | BOA | 0 | (31) | (31) | (0,02) |
| 03/2016 | 278 | 20.165 | FBF | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 04/2016 | BRL 504 | $ 148 | MSB | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| 04/2016 | JPY 840.000 | 6.988 | BPS | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| 05/2016 | ZAR 1.028 | 71 | MSB | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 07/2016 | BRL 500 | 130 | DUB | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| 10/2016 | 500 | 127 | BRC | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | | | | $ 891 | $ (1.247) | $ (356) | (0,20) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (2.170)** | **(1,20)** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (i)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (3.000) | $ (3.000) | (1,66) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | (300) | (309) | (0,17) |
| | | | $ (3.309) | (1,83) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (3.309)** | **(1,83)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 180.881** | **99,96** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 22 | $ 32 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 34 | 34 | 0,02 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 71 | 52 | 0,03 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 88 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 955 | 955 | 0,53 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 10 | 10 | 0,01 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 298 | 298 | 0,16 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 1 | 1 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 4 | 3 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 287 | 287 | 0,16 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 42 | 30 | 0,02 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 4 | 1 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 763 | 828 | 0,46 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 37 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 7 | 10 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7 | 7 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 2.553** | **1,41** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (2.476)** | **(1,37)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 180.958** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

(a) Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.

(b) Das Wertpapier ist in Verzug.

(c) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(e) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 974 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

**(g) Barmittel in Höhe von USD 1.912 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(h) Barmittel in Höhe von USD 101 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(i) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(j) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Towergate Finance PLC | 02.04.2015 | $ 0 | $ 11 | 0,01 |

**(k) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 34.479 | $ 152.039 | $ 11 | $ 186.529 |
| Finanzderivate[3] | (6) | (2.333) | 0 | (2.339) |
| Leerverkäufe | 0 | (3.309) | 0 | (3.309) |
| **Summen** | **$ 34.473** | **$ 146.397** | **$ 11** | **$ 180.881** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 20.642 | $ 51.713 | $ 282 | $ 72.637 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (350) | 0 | (350) |
| **Summen** | **$ 20.642** | **$ 51.363** | **$ 282** | **$ 72.287** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(l) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 1.086 | $ | 794 | BOA | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 172 | BRL | 673 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 673 | $ | 178 | DUB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 1.546 | | 1.159 | BOA | 46 | 0 | 46 | 0,03 |
| 01/2016 | CHF | 1.196 | | 1.169 | SCX | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| 01/2016 | DKK | 1.002 | | 143 | SCX | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 36.621 | | 40.240 | BOA | 458 | 0 | 458 | 0,25 |
| 01/2016 | $ | 40.009 | € | 37.525 | BOA | 754 | 0 | 754 | 0,42 |
| 01/2016 | | 436 | | 410 | BPS | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 58 | $ | 63 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.077 | | 2.256 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 30.379 | € | 28.660 | CBK | 755 | 0 | 755 | 0,42 |
| 01/2016 | € | 39.911 | $ | 43.564 | CBK | 253 | (45) | 208 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 189 | € | 177 | DUB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | | 39.799 | | 37.438 | MSB | 870 | 0 | 870 | 0,48 |
| 01/2016 | | 52 | | 49 | NAB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 313 | $ | 341 | RBC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 36.368 | | 39.720 | UAG | 217 | (4) | 213 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 40.018 | € | 37.651 | UAG | 884 | (1) | 883 | 0,49 |
| 01/2016 | £ | 1 | $ | 2 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2 | £ | 1 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 7 | $ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6 | £ | 4 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 1 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.812 | $ | 2.732 | MSB | 61 | 0 | 61 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 2.677 | £ | 1.808 | MSB | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| 01/2016 | | 6 | | 4 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 9 | | 6 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 2 | $ | 3 | UAG | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 7.688 | | 116 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 22 | JPY | 2.700 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 412.644 | $ | 3.363 | BOA | 0 | (67) | (67) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 2 | JPY | 263 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 241 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 225 | $ | 2 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 0 | JPY | 50 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.392 | | 410.428 | MSB | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| 01/2016 | | 7 | | 864 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 998 | $ | 8 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 458.305 | | 392 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | NOK | 471 | | 54 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | RUB | 5.547 | | 82 | BRC | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 78 | RUB | 5.547 | MSB | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | SEK | 2.507 | $ | 289 | CBK | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 673 | | 170 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 40.281 | € | 36.633 | BOA | 0 | (458) | (458) | (0,25) |
| 02/2016 | | 40.078 | | 36.638 | CBK | 0 | (250) | (250) | (0,14) |
| 02/2016 | $ | 39.581 | € | 36.211 | UAG | 0 | (217) | (217) | (0,12) |
| 02/2016 | £ | 1.808 | $ | 2.677 | MSB | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| 02/2016 | HKD | 9.837 | | 1.270 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | INR | 6.672 | | 100 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 33 | | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 51 | | 0 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 410.428 | | 3.394 | MSB | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| 02/2016 | SGD | 138 | | 98 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 11.392 | | 350 | UAG | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 03/2016 | MXN | 1.368 | | 78 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | RUB | 5.547 | | 77 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 05/2016 | ZAR | 2.803 | | 193 | MSB | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| | | | | | | $ 4.392 | $ (1.116) | $ 3.276 | 1,81 |

**(m) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 125 | $ 136 | $ (1) | $ 0 | $ (1) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(n) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 47 | $ 0 | $ 47 |
| BOA | (83) | 210 | 127 |
| BPS | (354) | 300 | (54) |
| BRC | 9 | 0 | 9 |
| CBK | 682 | (990) | (308) |
| DUB | (115) | 0 | (115) |
| FBF | 11 | 0 | 11 |
| GLM | (33) | 0 | (33) |
| GST | (217) | 0 | (217) |
| HUS | (93) | 0 | (93) |
| JPM | (132) | 0 | (132) |
| MEI | (10) | 0 | (10) |
| MSB | 935 | (1.030) | (95) |
| MYC | (394) | 344 | (50) |
| NAB | 1 | 0 | 1 |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| SCX | (30) | 0 | (30) |
| UAG | 880 | (1.100) | (220) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(o) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 103,08 | 101,61 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,09) | 0,17 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (1,20) | (0,66) |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (1,83) | 0,00 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Strategic Income Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 18.02.2016 | $ | 32.500 | $ 32.480 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,115 % fällig am 09.10.2015 | | 28.700 | 28.697 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,130 % fällig am 14.10.2015 | | 21.600 | 21.598 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,017 % fällig am 28.05.2015 | | 12.600 | 12.600 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.220.233 | 12.211 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | $ | 11.800 | 11.797 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,190 % fällig am 22.01.2016 | | 11.400 | 11.395 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 11.100 | 11.097 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.05.2015 | | 10.300 | 10.299 |
| **Stichting Halcyon Structured Asset Management European CLO** | | | |
| 0,469 % fällig am 24.07.2023 | € | 8.992 | 9.712 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,011 % fällig am 04.06.2015 | $ | 7.400 | 7.399 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,225 % fällig am 14.01.2016 | | 7.200 | 7.194 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,040)% fällig am 07.04.2016 | JPY | 840.000 | 6.968 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,310 % fällig am 26.01.2016 | $ | 6.900 | 6.896 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,255 % fällig am 29.01.2016 | | 6.600 | 6.598 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 09.11.2015 | | 6.500 | 6.498 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,180 % fällig am 03.02.2016 | | 6.500 | 6.496 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | | 6.000 | 6.000 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,231 % fällig am 27.01.2016 | | 5.400 | 5.397 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,074 % fällig am 31.07.2015 | | 5.300 | 5.299 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 18.02.2016 | $ | 32.500 | $ 32.499 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,115 % fällig am 09.10.2015 | | 22.900 | 22.898 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.916.935 | 19.182 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,130 % fällig am 14.10.2015 | $ | 15.800 | 15.799 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,017 % fällig am 28.05.2015 | | 14.100 | 14.100 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.01.2016 | | 11.800 | 11.798 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,190 % fällig am 22.01.2016 | | 11.400 | 11.397 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.05.2015 | | 10.300 | 10.299 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2016 | | 10.300 | 10.297 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,011 % fällig am 04.06.2015 | | 7.400 | 7.400 |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,225 % fällig am 14.01.2016 | | 7.200 | 7.195 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 09.11.2015 | | 6.500 | 6.498 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,180 % fällig am 03.02.2016 | | 6.500 | 6.497 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 21.05.2015 | | 6.000 | 6.000 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,310 % fällig am 26.01.2016 | | 5.800 | 5.798 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,074 % fällig am 31.07.2015 | | 5.300 | 5.299 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,090 % fällig am 11.09.2015 | | 4.900 | 4.899 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,056 % fällig am 14.08.2015 | | 4.500 | 4.500 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.10.2015 | | 4.500 | 4.499 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,019 % fällig am 09.04.2015 | | 4.459 | 4.459 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,231 % fällig am 27.01.2016 | | 4.300 | 4.298 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,092 % fällig am 21.08.2015 | | 4.200 | 4.200 |
| **Stichting Halcyon Structured Asset Management European CLO** | | | |
| 0,469 % fällig am 24.07.2023 | € | 4.000 | 4.120 |

(a) Der Strategic Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | | 8.101.186 | $ 81.012 | 1,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Avago Technologies Cayman Ltd. 4,250 % fällig am 06.11.2022 | $ | 10.000 | 9.893 | 0,14 |
| Chrysler Group LLC 3,500 % fällig am 24.05.2017 | | 19.306 | 19.272 | 0,27 |
| Community Health Systems, Inc. 3,657 % fällig am 31.12.2018 | | 8.690 | 8.580 | 0,12 |
| Energy Future Intermediate Holding Co. LLC 4,250 % fällig am 19.06.2016 | | 19.427 | 19.393 | 0,27 |
| HCA, Inc. 3,174 % fällig am 31.03.2017 | | 18.516 | 18.515 | 0,25 |
| Swissport International Ltd. 6,250 % fällig am 30.11.2021 | € | 3.000 | 3.263 | 0,04 |
| | | | 78.916 | 1,09 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| American Campus Communities Operating Partnership LP 3,350 % fällig am 01.10.2020 | $ | 8.800 | 8.797 | 0,12 |
| American Express Bank FSB 6,000 % fällig am 13.09.2017 | | 19.000 | 20.357 | 0,28 |
| Banco de Credito e Inversiones 3,000 % fällig am 13.09.2017 | | 16.000 | 16.108 | 0,22 |
| Banco Santander Brasil S.A. 4,250 % fällig am 14.01.2016 | | 5.000 | 4.994 | 0,07 |
| Banco Santander Chile 1,221 % fällig am 11.04.2017 | | 3.700 | 3.658 | 0,05 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 4,125 % fällig am 27.04.2017 | | 13.000 | 13.163 | 0,18 |
| Bank of America Corp. 0,692 % fällig am 15.08.2016 | | 2.500 | 2.488 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 11.01.2018 | | 7.300 | 7.294 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 6.400 | 6.557 | 0,09 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 9.000 | 9.645 | 0,13 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 67.200 | 74.179 | 1,03 |
| 7,625 % fällig am 01.06.2019 | | 9.200 | 10.665 | 0,15 |
| Bank of America N.A. 0,812 % fällig am 15.06.2017 | | 2.500 | 2.481 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2036 | | 2.300 | 2.739 | 0,04 |
| 6,100 % fällig am 15.06.2017 | | 4.300 | 4.545 | 0,06 |
| Bank of China Hong Kong Ltd. 5,550 % fällig am 11.02.2020 | | 8.100 | 8.827 | 0,12 |
| Barclays Bank PLC 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 14.900 | 19.335 | 0,27 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 10.100 | 19.283 | 0,27 |
| Barclays PLC 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 2.400 | 3.544 | 0,05 |
| BBVA Bancomer S.A. 6,500 % fällig am 10.03.2021 | $ | 200 | 213 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 22.04.2020 | | 28.000 | 29.869 | 0,41 |
| Bear Stearns Cos. LLC 6,400 % fällig am 02.10.2017 | | 3.600 | 3.878 | 0,05 |
| BM&FBovespa S.A. - Bolsa de Valores Mercadorias e Futuros 5,500 % fällig am 16.07.2020 | | 15.800 | 15.603 | 0,22 |
| Caixa Economica Federal 2,375 % fällig am 06.11.2017 | | 16.000 | 14.760 | 0,21 |
| Charles Schwab Corp. 3,450 % fällig am 13.02.2026 | | 3.100 | 3.156 | 0,04 |
| Citigroup, Inc. 1,280 % fällig am 25.07.2016 | | 4.000 | 4.006 | 0,06 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 11.700 | 11.618 | 0,16 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 6.700 | 8.679 | 0,12 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 30.000 | 37.148 | 0,52 |
| Credit Agricole S.A. 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 6.631 | $ 7.419 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | £ | 22.400 | 32.541 | 0,45 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 10.320 | 10.002 | 0,14 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 9.500 | 9.506 | 0,13 |
| Dexia Credit Local S.A. 1,875 % fällig am 29.01.2020 | | 6.900 | 6.791 | 0,09 |
| Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 Class A Pass-Through Trust 5,125 % fällig am 30.11.2022 | | 4.757 | 4.872 | 0,07 |
| Eksportfinans ASA 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 2.000 | 2.003 | 0,03 |
| Fifth Third Bancorp 0,990 % fällig am 20.12.2016 | | 7.530 | 7.502 | 0,10 |
| Glen Meadow Pass-Through Trust 6,505 % fällig am 12.02.2067 | | 9.300 | 7.440 | 0,10 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 1,476 % fällig am 23.04.2020 | | 1.800 | 1.805 | 0,03 |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 10.000 | 10.033 | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 7.000 | 7.060 | 0,10 |
| Grupo Aval Ltd. 4,750 % fällig am 26.09.2022 | | 17.000 | 16.012 | 0,22 |
| GSPA Monetization Trust 6,422 % fällig am 09.10.2029 | | 16.798 | 18.812 | 0,26 |
| HBOS PLC 6,750 % fällig am 21.05.2018 | | 2.000 | 2.186 | 0,03 |
| Host Hotels & Resorts LP 4,500 % fällig am 01.02.2026 | | 7.800 | 7.715 | 0,11 |
| HSBC Bank USA N.A. 6,000 % fällig am 09.08.2017 | | 49.100 | 52.242 | 0,72 |
| HSBC Finance Corp. 6,676 % fällig am 15.01.2021 | | 1.800 | 2.068 | 0,03 |
| HSBC Holdings PLC 6,500 % fällig am 02.05.2036 | | 9.100 | 10.893 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2037 | | 21.100 | 25.393 | 0,35 |
| Ibercaja Banco S.A. 5,000 % fällig am 28.07.2025 | € | 8.100 | 8.447 | 0,12 |
| Industrial Bank of Korea 2,375 % fällig am 17.07.2017 | $ | 1.900 | 1.913 | 0,03 |
| International Lease Finance Corp. 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 10.700 | 11.008 | 0,15 |
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | | 6.075 | 6.675 | 0,09 |
| Intesa Sanpaolo SpA 2,375 % fällig am 13.01.2017 | | 7.800 | 7.827 | 0,11 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 9.500 | 9.505 | 0,13 |
| JPMorgan Chase & Co. 0,870 % fällig am 25.04.2018 | | 22.300 | 22.157 | 0,31 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 21.400 | 22.079 | 0,31 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. 6,000 % fällig am 01.10.2017 | | 14.000 | 14.972 | 0,21 |
| KeyCorp 2,900 % fällig am 15.09.2020 | | 10.000 | 9.973 | 0,14 |
| Korea Exchange Bank 3,125 % fällig am 26.06.2017 | | 12.800 | 13.001 | 0,18 |
| Lloyds Bank PLC 12,000 % fällig am 29.12.2049 (b) | | 800 | 1.141 | 0,02 |
| Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 77.070 | 119.256 | 1,65 |
| Mid-America Apartments LP 3,750 % fällig am 15.06.2024 | $ | 2.061 | 2.023 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.10.2023 | | 3.700 | 3.797 | 0,05 |
| Nationwide Building Society 6,250 % fällig am 25.02.2020 | | 1.700 | 1.945 | 0,03 |
| Navient Corp. 4,875 % fällig am 17.06.2019 | | 1.800 | 1.661 | 0,02 |
| Novo Banco S.A. 5,000 % fällig am 14.05.2019 | € | 2.562 | 2.440 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 23.05.2019 | | 3.919 | 3.852 | 0,05 |
| OMX Timber Finance Investments I LLC 5,420 % fällig am 29.01.2020 | $ | 7.000 | 7.623 | 0,11 |
| Piper Jaffray Cos 5,060 % fällig am 09.10.2018 | | 6.000 | 5.990 | 0,08 |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 18.900 | 19.755 | 0,27 |
| Royal Bank of Canada 2,100 % fällig am 14.10.2020 | $ | 17.600 | $ 17.318 | 0,24 |
| Society of Lloyd's 4,750 % fällig am 30.10.2024 | £ | 19.600 | 29.885 | 0,41 |
| Svenska Handelsbanken AB 2,400 % fällig am 01.10.2020 | $ | 14.800 | 14.706 | 0,20 |
| Tesco Property Finance 3 PLC 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 5.900 | 7.658 | 0,11 |
| UBS AG 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 21.200 | 21.465 | 0,30 |
| UDR, Inc. 4,000 % fällig am 01.10.2025 | | 6.500 | 6.575 | 0,09 |
| United Overseas Bank Ltd. 2,500 % fällig am 18.03.2020 | | 22.800 | 22.946 | 0,32 |
| Wells Fargo & Co. 0,716 % fällig am 02.06.2017 | | 34.600 | 34.471 | 0,48 |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 | | 18.000 | 18.184 | 0,25 |
| | | | 1.080.132 | 14,96 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Altria Group, Inc. 4,750 % fällig am 05.05.2021 | | 500 | 543 | 0,01 |
| Apple, Inc. 2,850 % fällig am 06.05.2021 | | 7.400 | 7.584 | 0,10 |
| Athens Urban Transportation Organisation 4,851 % fällig am 19.09.2016 | € | 1.100 | 1.116 | 0,02 |
| CCO Safari II LLC 4,464 % fällig am 23.07.2022 | $ | 6.100 | 6.086 | 0,08 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 19.900 | 19.911 | 0,28 |
| CNOOC Finance 2013 Ltd. 3,000 % fällig am 09.05.2023 | | 5.300 | 4.977 | 0,07 |
| ConAgra Foods, Inc. 0,687 % fällig am 21.07.2016 | | 4.100 | 4.093 | 0,06 |
| CSN Islands XI Corp. 6,875 % fällig am 21.09.2019 (b) | | 3.200 | 1.696 | 0,02 |
| Daimler Finance N.A. LLC 1,450 % fällig am 01.08.2016 | | 6.405 | 6.414 | 0,09 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 0,794 % fällig am 08.11.2016 | | 11.300 | 11.223 | 0,16 |
| 0,982 % fällig am 08.09.2017 | | 11.800 | 11.640 | 0,16 |
| 1,022 % fällig am 06.12.2017 | | 21.000 | 20.740 | 0,29 |
| 1,259 % fällig am 09.01.2018 | | 23.300 | 23.078 | 0,32 |
| 3,984 % fällig am 15.06.2016 | | 6.300 | 6.371 | 0,09 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2016 | | 9.900 | 10.470 | 0,14 |
| General Motors Financial Co., Inc. 3,150 % fällig am 15.01.2020 | | 14.300 | 14.185 | 0,20 |
| Gerdau Trade, Inc. 5,750 % fällig am 30.01.2021 | | 2.200 | 1.754 | 0,02 |
| Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd. 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 3.300 | 2.475 | 0,03 |
| Hellenic Railways Organization S.A. 4,500 % fällig am 06.12.2016 | JPY | 2.900 | 22 | 0,00 |
| Kinder Morgan, Inc. 7,250 % fällig am 01.06.2018 | $ | 11.000 | 11.428 | 0,16 |
| Latam Airlines 2015-1 Pass-Through Trust A 4,200 % fällig am 15.11.2027 | | 20.800 | 19.552 | 0,27 |
| Phillips 66 4,300 % fällig am 01.04.2022 | | 1.700 | 1.751 | 0,02 |
| President & Fellows of Harvard College 6,500 % fällig am 15.01.2039 | | 1.400 | 1.935 | 0,03 |
| RCI Banque S.A. 4,600 % fällig am 12.04.2016 | | 1.953 | 1.970 | 0,03 |
| Regency Energy Partners LP 4,500 % fällig am 01.11.2023 | | 7.059 | 6.117 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 1.150 | 1.125 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 2.350 | 2.218 | 0,03 |
| Reynolds Group Issuer, Inc. 5,750 % fällig am 15.10.2020 | | 4.200 | 4.283 | 0,06 |
| Rohm & Haas Co. 6,000 % fällig am 15.09.2017 | | 544 | 579 | 0,01 |
| Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. 2,750 % fällig am 17.05.2017 | | 8.100 | 8.174 | 0,11 |
| UAL 2009-1 Pass-Through Trust 10,400 % fällig am 01.11.2016 | | 8.510 | 9.032 | 0,12 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 6,750 % fällig am 15.08.2021 | | 300 | 291 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 1,023 % fällig am 26.06.2017 | $ 104.200 | $ 100.772 | 1,40 |
| | | 323.605 | 4,48 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **Embarq Corp.** | | | |
| 7,995 % fällig am 01.06.2036 | 9.800 | 10.118 | 0,14 |
| **Entergy Gulf States Louisiana LLC** | | | |
| 3,950 % fällig am 01.10.2020 | 3.000 | 3.161 | 0,04 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | 400 | 408 | 0,01 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 5,950 % fällig am 15.02.2018 | 6.090 | 6.247 | 0,09 |
| 6,850 % fällig am 15.02.2020 | 4.500 | 4.659 | 0,06 |
| **Majapahit Holding BV** | | | |
| 7,250 % fällig am 28.06.2017 | 4.600 | 4.899 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | 9.200 | 10.316 | 0,14 |
| 8,000 % fällig am 07.08.2019 | 5.000 | 5.613 | 0,08 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | |
| 6,650 % fällig am 15.06.2067 | 791 | 604 | 0,01 |
| **Ooredoo International Finance Ltd.** | | | |
| 3,375 % fällig am 14.10.2016 | 5.900 | 5.972 | 0,08 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 1,990 % fällig am 20.05.2016 | 3.900 | 3.812 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | 4.000 | 3.950 | 0,05 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | 6.800 | 5.185 | 0,07 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | 4.300 | 3.951 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2016 | 17.100 | 17.053 | 0,24 |
| 4,375 % fällig am 20.05.2023 | 100 | 66 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | 10.400 | 8.190 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | 13.000 | 11.602 | 0,16 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | 10.200 | 6.655 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2019 | 11.200 | 9.940 | 0,14 |
| 8,375 % fällig am 10.12.2018 (b) | 7.700 | 7.103 | 0,10 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. II** | | | |
| 5,298 % fällig am 30.09.2020 | 11.920 | 12.729 | 0,18 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | 19.950 | 22.041 | 0,31 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | 3.300 | 3.839 | 0,05 |
| **Telefonica Chile S.A.** | | | |
| 3,875 % fällig am 12.10.2022 | 29.300 | 28.955 | 0,40 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 | 5.100 | 5.225 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 14.09.2018 (b) | 16.200 | 16.951 | 0,24 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | 7.200 | 7.928 | 0,11 |
| **Verizon New Jersey, Inc.** | | | |
| 7,850 % fällig am 15.11.2029 | 310 | 373 | 0,01 |
| **Williams Partners LP** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | 14.475 | 11.752 | 0,16 |
| | | 239.297 | 3,31 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | 1.643.034 | 22,75 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Alameda, California, Bay Area Toll Authority Toll Bridge Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,907 % fällig am 01.10.2050 | 7.300 | 10.037 | 0,14 |
| **Alameda, California, Bay Area Toll Bridge Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,043 % fällig am 01.04.2050 | 36.500 | 50.347 | 0,70 |
| **Alameda, California, Joint Powers Authority Lease Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,046 % fällig am 01.12.2044 | 14.400 | 18.899 | 0,26 |
| **Albany, New York, State Dormitory Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 5,051 % fällig am 15.09.2027 | 100 | 113 | 0,00 |
| **Clark, Nevada, General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,572 % fällig am 01.06.2040 | 13.900 | 12.448 | 0,17 |
| **Cook County, Illinois, General Obligation Bonds, Series 2008** | | | |
| 5,630 % fällig am 01.01.2022 | 4.700 | 4.644 | 0,07 |
| **Cook County, Illinois, Transit Authority Revenue Bonds, Series 2008** | | | |
| 6,300 % fällig am 01.12.2021 | 235 | 252 | 0,00 |
| 6,899 % fällig am 01.12.2040 | 8.100 | 9.422 | 0,13 |
| **Cook County, Illinois, Transit Authority Sales Tax Receipts Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,200 % fällig am 01.12.2040 | 4.500 | 4.887 | 0,07 |
| **Davidson County, Tennessee, Convention Center Authority, Subordinate Tourism Tax Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,731 % fällig am 01.07.2043 | $ 800 | $ 1.025 | 0,02 |
| **Denver, Colorado, Public Schools Certificate of Participation, Series 2011** | | | |
| 7,017 % fällig am 15.12.2037 | 15.000 | 19.722 | 0,27 |
| **Franklin, Ohio, American Municipal Power, Inc., Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 8,084 % fällig am 15.02.2050 | 17.100 | 25.237 | 0,35 |
| **Los Angeles, California, California State University Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,434 % fällig am 01.11.2030 | 100 | 126 | 0,00 |
| **Los Angeles, California, Unified School District General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,758 % fällig am 01.07.2034 | 10.200 | 13.450 | 0,19 |
| **Macoupin, Illinois, Public Financing Authority Lease Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,148 % fällig am 01.03.2043 | 11.100 | 14.658 | 0,20 |
| **Mercer, New Jersey, Economic Development Authority Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,425 % fällig am 15.12.2035 | 22.200 | 23.352 | 0,32 |
| **Orange, California, Ranch Water District Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,622 % fällig am 01.05.2040 | 3.300 | 4.246 | 0,06 |
| **Placer, California, Power Agency Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,311 % fällig am 01.06.2040 | 20.000 | 24.504 | 0,34 |
| **Polk County, Iowa, Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | 645 | 648 | 0,01 |
| **Riverside, California, Redevelopment Successor Agency, Series 2010** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.10.2030 | 9.820 | 10.799 | 0,15 |
| **Riverside, California, Riverside Community College District General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,971 % fällig am 01.08.2035 | 1.100 | 1.263 | 0,02 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2009** | | | |
| 7,350 % fällig am 01.11.2039 | 4.000 | 5.670 | 0,08 |
| 7,550 % fällig am 01.04.2039 | 13.100 | 19.041 | 0,26 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.03.2040 | 17.400 | 25.357 | 0,35 |
| | | 300.147 | 4,16 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,281 % fällig am 25.12.2036 | 224 | 223 | 0,00 |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | 1.522 | 1.431 | 0,02 |
| 0,542 % fällig am 25.03.2034 | 40 | 40 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.09.2042 | 1.336 | 1.330 | 0,02 |
| 1,022 % fällig am 25.05.2040 | 12.482 | 12.616 | 0,18 |
| 1,322 % fällig am 25.04.2032 | 72 | 74 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 01.10.2044 | 64 | 65 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 01.10.2040 | 17 | 17 | 0,00 |
| 1,985 % fällig am 01.12.2034 | 183 | 191 | 0,00 |
| 2,018 % fällig am 01.09.2035 | 121 | 130 | 0,00 |
| 2,217 % fällig am 01.11.2035 | 87 | 91 | 0,00 |
| 2,227 % fällig am 01.09.2035 | 74 | 78 | 0,00 |
| 2,255 % fällig am 01.04.2033 | 36 | 39 | 0,00 |
| 2,309 % fällig am 01.03.2036 | 28 | 29 | 0,00 |
| 2,326 % fällig am 25.05.2035 | 189 | 199 | 0,00 |
| 2,345 % fällig am 01.07.2035 | 175 | 183 | 0,00 |
| 2,354 % fällig am 01.03.2023 | 123.910 | 123.022 | 1,70 |
| 2,393 % fällig am 01.01.2036 | 42 | 45 | 0,00 |
| 2,440 % fällig am 01.09.2039 | 29 | 30 | 0,00 |
| 2,462 % fällig am 01.06.2035 | 2.378 | 2.520 | 0,04 |
| 2,483 % fällig am 01.09.2035 | 87 | 92 | 0,00 |
| 2,501 % fällig am 01.09.2034 | 86 | 91 | 0,00 |
| 2,505 % fällig am 01.03.2036 | 21 | 23 | 0,00 |
| 2,506 % fällig am 01.11.2025 | 4 | 4 | 0,00 |
| 2,519 % fällig am 01.07.2035 | 54 | 57 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 01.11.2034 | 185 | 196 | 0,00 |
| 2,627 % fällig am 01.05.2037 | 617 | 657 | 0,01 |
| 2,870 % fällig am 01.09.2027 | 22.100 | 21.589 | 0,30 |
| 3,000 % fällig am 01.02.2021 - 01.03.2029 | 780 | 805 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.08.2027 | 1.135 | 1.134 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 - 01.01.2021 | $ 82 | $ 86 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2018 - 01.07.2042 | 20.419 | 21.492 | 0,30 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2018 - 01.10.2042 | 43.589 | 46.695 | 0,65 |
| 4,611 % fällig am 01.09.2034 | 2.121 | 2.268 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2018 - 25.06.2043 | 2.230 | 2.410 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.01.2021 - 01.03.2040 | 34.917 | 38.962 | 0,54 |
| 5,735 % fällig am 25.12.2042 | 151 | 170 | 0,00 |
| 5,900 % fällig am 25.07.2042 | 88 | 98 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2016 - 01.05.2041 | 89.001 | 100.721 | 1,40 |
| 6,500 % fällig am 01.03.2017 - 01.03.2037 | 345 | 394 | 0,01 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2031 - 01.01.2046 | 185.000 | 186.432 | 2,58 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2031 - 01.02.2046 | 509.000 | 524.892 | 7,27 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2031 - 01.02.2046 | 751.000 | 791.965 | 10,97 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2046 - 01.02.2046 | 204.000 | 220.189 | 3,05 |
| 5,500 % fällig am 01.01.2046 | 219.000 | 244.159 | 3,38 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,811 % fällig am 15.10.2040 | 672 | 677 | 0,01 |
| 2,093 % fällig am 01.09.2035 | 160 | 168 | 0,00 |
| 2,400 % fällig am 01.09.2028 | 5 | 6 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2032 | 7 | 8 | 0,00 |
| 2,583 % fällig am 01.01.2028 | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,607 % fällig am 01.07.2027 | 6 | 7 | 0,00 |
| 2,658 % fällig am 01.07.2030 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,676 % fällig am 01.11.2035 | 88 | 94 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 15.09.2040 | 2.192 | 2.178 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2029 - 01.02.2042 | 1.574 | 1.676 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.05.2039 | 1.770 | 1.916 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 - 01.06.2039 | 10.395 | 11.565 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2016 - 01.05.2040 | 24.595 | 27.778 | 0,39 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2028 | 247 | 281 | 0,00 |
| 8,991 % fällig am 15.03.2044 | 43.632 | 51.267 | 0,71 |
| 11,119 % fällig am 15.07.2043 | 5.064 | 5.354 | 0,08 |
| **Freddie Mac TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 - 01.02.2046 | 90.000 | 92.571 | 1,28 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2046 | 86.000 | 90.856 | 1,26 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2046 | 70.000 | 75.418 | 1,05 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,645 % fällig am 16.01.2031 | 58 | 58 | 0,00 |
| 0,662 % fällig am 20.09.2065 | 3.900 | 3.892 | 0,05 |
| 0,712 % fällig am 20.08.2062 | 4.386 | 4.383 | 0,06 |
| 0,792 % fällig am 20.08.2065 - 20.09.2065 | 38.930 | 38.562 | 0,54 |
| 0,845 % fällig am 16.02.2030 | 13 | 13 | 0,00 |
| 0,945 % fällig am 16.02.2030 | 17 | 17 | 0,00 |
| 1,625 % fällig am 20.12.2034 | 102 | 106 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 20.02.2028 - 20.01.2032 | 115 | 118 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 20.07.2025 - 20.07.2034 | 226 | 234 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 20.10.2026 | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2034 - 15.05.2042 | 19.824 | 21.940 | 0,30 |
| 6,000 % fällig am 20.09.2038 - 15.08.2039 | 83 | 94 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 20.05.2031 | 24 | 27 | 0,00 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | 3.000 | 3.038 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2046 - 15.02.2046 | 74.000 | 77.047 | 1,07 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 - 20.01.2046 | 65.000 | 69.017 | 0,96 |
| 5,000 % fällig am 01.01.2046 | 1.000 | 1.096 | 0,02 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 5,870 % fällig am 01.07.2028 | 76 | 86 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,220 % fällig am 01.12.2028 | $ | 3.698 | $ 4.207 | 0,06 |
| | | | 2.933.696 | 40,63 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 - 15.01.2023 (d)(e) | | 310.740 | 301.248 | 4,17 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 9.640 | 9.210 | 0,13 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 - 15.07.2025 (d)(e) | | 67.192 | 65.689 | 0,91 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 - 15.02.2045 | | 37.128 | 32.490 | 0,45 |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (d)(e) | | 17.340 | 18.049 | 0,25 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 7.756 | 7.911 | 0,11 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 112.052 | 122.596 | 1,70 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 133.851 | 148.884 | 2,06 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 - 15.01.2027 | | 279.764 | 320.960 | 4,44 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 131.049 | 155.490 | 2,15 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 | | 9.264 | 12.127 | 0,17 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | | 60.475 | 82.281 | 1,14 |
| **US Treasury Bonds** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 (d) | | 27.700 | 27.993 | 0,39 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 17.200 | 15.437 | 0,21 |
| 2,750 % fällig am 15.08.2042 - 15.11.2042 | | 116.700 | 111.421 | 1,54 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2043 - 15.08.2045 (b) | | 164.400 | 159.796 | 2,21 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042 - 15.11.2045 (b) | | 257.000 | 256.873 | 3,56 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2042 - 15.08.2044 (b) | | 413.300 | 422.959 | 5,86 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2044 | | 28.100 | 30.166 | 0,42 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2039 | | 50.700 | 62.649 | 0,87 |
| 4,375 % fällig am 15.11.2039 - 15.05.2040 | | 110.600 | 139.121 | 1,93 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2039 | | 44.600 | 57.098 | 0,79 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 | | 11.700 | 15.244 | 0,21 |
| **US Treasury Notes** | | | | |
| 1,375 % fällig am 31.03.2020 - 30.04.2020 (d)(e) | | 65.200 | 64.376 | 0,89 |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 - 30.09.2022 | | 281.400 | 276.230 | 3,83 |
| 2,000 % fällig am 31.08.2021 - 31.10.2021 (d) | | 42.500 | 42.637 | 0,59 |
| | | | 2.958.935 | 40,98 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | | 11.000 | 9.713 | 0,13 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.10.2036 | | 562 | 303 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,862 % fällig am 25.06.2035 | | 5.900 | 5.508 | 0,08 |
| **Aire Valley Mortgages PLC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 20.09.2066 | | 2.064 | 1.975 | 0,03 |
| 0,810 % fällig am 20.09.2066 | | 9.830 | 9.411 | 0,13 |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 20.02.2047 (f) | | 16.433 | 12.402 | 0,17 |
| 0,602 % fällig am 25.05.2047 | | 2.916 | 2.410 | 0,03 |
| 0,612 % fällig am 25.10.2046 | | 1.084 | 1.060 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 (f) | | 443 | 382 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (f) | | 4.679 | 4.078 | 0,06 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.02.2044 | | 6.804 | 6.792 | 0,09 |
| 2,654 % fällig am 25.02.2045 | | 790 | 790 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.03.2036 | | 4.000 | 3.520 | 0,05 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.01.2036 | | 10.000 | 8.376 | 0,12 |
| 1,042 % fällig am 25.05.2035 | | 7.300 | 6.007 | 0,08 |
| 1,442 % fällig am 25.10.2034 | | 3.700 | 3.325 | 0,05 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 1,002 % fällig am 25.07.2032 | | 74 | 69 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 1,122 % fällig am 25.06.2034 | | 214 | 201 | 0,00 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,972 % fällig am 25.09.2034 | $ | 21 | $ 21 | 0,00 |
| **Auburn Securities 9 PLC** | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | £ | 4.826 | 7.071 | 0,10 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,451 % fällig am 15.01.2049 | $ | 527 | 541 | 0,01 |
| 5,834 % fällig am 10.05.2045 | | 2.286 | 2.290 | 0,03 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,512 % fällig am 25.06.2034 | | 884 | 889 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2035 | | 9.789 | 9.989 | 0,14 |
| 2,858 % fällig am 20.09.2035 (f) | | 6.039 | 5.234 | 0,07 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 2,658 % fällig am 25.03.2035 | | 2.211 | 2.059 | 0,03 |
| 2,677 % fällig am 25.07.2034 | | 935 | 954 | 0,01 |
| 2,810 % fällig am 25.07.2035 (f) | | 2.129 | 1.984 | 0,03 |
| 2,815 % fällig am 25.09.2034 | | 4.275 | 4.204 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2020 | | 564 | 577 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,320 % fällig am 25.08.2035 | | 6.404 | 6.477 | 0,09 |
| 2,480 % fällig am 25.08.2035 | | 27 | 27 | 0,00 |
| 2,537 % fällig am 25.04.2033 | | 148 | 149 | 0,00 |
| 2,546 % fällig am 25.04.2034 | | 557 | 494 | 0,01 |
| 2,768 % fällig am 25.11.2030 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,832 % fällig am 25.04.2034 | | 775 | 756 | 0,01 |
| 2,858 % fällig am 25.04.2034 | | 305 | 296 | 0,00 |
| 2,868 % fällig am 25.01.2034 | | 664 | 665 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2034 | | 418 | 409 | 0,01 |
| 2,928 % fällig am 25.07.2034 | | 28 | 27 | 0,00 |
| 3,059 % fällig am 25.12.2035 | | 1.340 | 1.362 | 0,02 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2034 | | 158 | 145 | 0,00 |
| 2,601 % fällig am 25.05.2035 | | 1.856 | 1.804 | 0,03 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | | 1.575 | 1.339 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | | |
| 0,852 % fällig am 25.12.2035 | | 3.773 | 3.368 | 0,05 |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | | 1.063 | 989 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 (f) | | 5.544 | 5.511 | 0,08 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,622 % fällig am 25.01.2045 | | 1.091 | 877 | 0,01 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,700 % fällig am 11.06.2050 | | 7.700 | 8.033 | 0,11 |
| **Citigroup & Deutsche Bank Mortgage Trust** | | | | |
| 5,617 % fällig am 15.10.2048 | | 275 | 278 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 0,662 % fällig am 25.11.2036 | | 6.400 | 5.780 | 0,08 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2037 (f) | | 11.778 | 5.626 | 0,08 |
| 1,002 % fällig am 25.07.2035 | | 3.900 | 3.482 | 0,05 |
| 2,430 % fällig am 25.09.2035 | | 7.441 | 7.458 | 0,10 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2035 | | 305 | 302 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.06.2036 | | 65 | 65 | 0,00 |
| 0,602 % fällig am 25.07.2036 | | 1.486 | 1.463 | 0,02 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | | 3.263 | 3.240 | 0,05 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 1,277 % fällig am 25.08.2034 | | 3.259 | 3.100 | 0,04 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.04.2046 | | 2.400 | 2.129 | 0,03 |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | | 269 | 237 | 0,00 |
| 2,125 % fällig am 19.07.2031 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.02.2036 (f) | | 435 | 408 | 0,01 |
| 2,596 % fällig am 20.10.2035 | | 13.953 | 12.691 | 0,18 |
| 2,646 % fällig am 25.11.2034 | | 1.864 | 1.778 | 0,03 |
| 2,671 % fällig am 20.02.2035 | | 2.761 | 2.754 | 0,04 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,297 % fällig am 15.12.2039 | | 13.230 | 13.534 | 0,19 |
| 5,383 % fällig am 15.02.2040 | | 292 | 298 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 2,265 % fällig am 25.06.2033 | | 24 | 23 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 (f) | | 3.521 | 2.343 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | | |
| 2,370 % fällig am 26.04.2038 | | 17.900 | 17.590 | 0,24 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust (f)** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.04.2036 | | 2.092 | 1.757 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 4.200 | 3.425 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 1.484 | 1.233 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | | 202 | 112 | 0,00 |
| **Deco 2014-BONN Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.11.2024 | € | 33.334 | $ 36.285 | 0,50 |
| **DECO Charlemagne S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 27.04.2025 | | 27.121 | 29.513 | 0,41 |
| **Deco Gondola Srl** | | | | |
| 1,358 % fällig am 22.02.2026 | | 4.949 | 5.351 | 0,07 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,732 % fällig am 19.09.2045 | $ | 7.122 | 5.249 | 0,07 |
| 2,547 % fällig am 19.07.2044 | | 42 | 42 | 0,00 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | £ | 12.912 | 18.691 | 0,26 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,733 % fällig am 15.06.2044 | | 7.401 | 10.166 | 0,14 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | | |
| 1,443 % fällig am 25.10.2044 | $ | 72 | 73 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 25.02.2045 | | 187 | 190 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 25.07.2044 | | 449 | 456 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,912 % fällig am 25.09.2035 | | 6.809 | 6.664 | 0,09 |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | | 1.265 | 1.239 | 0,02 |
| 1,232 % fällig am 25.04.2035 | | 3.908 | 3.708 | 0,05 |
| 1,307 % fällig am 25.03.2035 | | 2.372 | 2.204 | 0,03 |
| 1,697 % fällig am 25.07.2034 | | 3.675 | 3.427 | 0,05 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,360 % fällig am 25.10.2034 | | 815 | 807 | 0,01 |
| **Fosse Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,348 % fällig am 18.10.2054 | € | 1.654 | 1.806 | 0,03 |
| **GCAT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2020 | $ | 7.224 | 7.168 | 0,10 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,462 % fällig am 25.08.2036 | | 55 | 28 | 0,00 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | £ | 11.166 | 16.502 | 0,23 |
| 2,135 % fällig am 19.12.2047 | | 1.090 | 1.614 | 0,02 |
| **Granite Mortgages PLC** | | | | |
| 0,962 % fällig am 20.01.2044 | | 692 | 1.019 | 0,01 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 1,272 % fällig am 25.02.2047 | $ | 11.633 | 11.384 | 0,16 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,261 % fällig am 25.06.2034 | | 216 | 206 | 0,00 |
| 2,311 % fällig am 25.06.2034 | | 346 | 338 | 0,01 |
| 2,806 % fällig am 25.09.2035 | | 13.471 | 13.816 | 0,19 |
| 2,869 % fällig am 25.01.2036 (f) | | 8.287 | 7.754 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 (f) | | 137 | 131 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 19.01.2038 | | 247 | 203 | 0,00 |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | | 641 | 537 | 0,01 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.10.2035 | | 1.073 | 1.000 | 0,01 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | | |
| 0,782 % fällig am 25.12.2035 | | 16.398 | 14.070 | 0,20 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,864 % fällig am 25.01.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,358 % fällig am 15.11.2048 | | 23.113 | 23.367 | 0,32 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,440 % fällig am 12.06.2047 | | 1.533 | 1.570 | 0,02 |
| 5,695 % fällig am 12.02.2049 | | 299 | 308 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.01.2037 | | 5.000 | 4.470 | 0,06 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,683 % fällig am 25.07.2035 | | 888 | 882 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 (f) | | 881 | 775 | 0,01 |
| **Landmark Mortgage Securities No. 3 PLC** | | | | |
| 0,859 % fällig am 17.04.2044 | £ | 15.470 | 20.656 | 0,29 |
| **Leek Finance Number Eighteen PLC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 21.09.2038 | $ | 9.128 | 9.637 | 0,13 |
| **Leek Finance Number Nineteen PLC** | | | | |
| 0,790 % fällig am 21.12.2038 | | 33.289 | 34.867 | 0,48 |
| **Leek Finance Number Seventeen PLC** | | | | |
| 0,865 % fällig am 21.12.2037 | £ | 4.681 | 7.262 | 0,10 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,690 % fällig am 25.01.2036 | $ | 111 | 110 | 0,00 |
| 2,772 % fällig am 21.11.2034 | | 14.257 | 14.622 | 0,20 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2033 | | 14 | 14 | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.10.2035 | $ | 2.221 | $ 2.196 | 0,03 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.05.2035 | | 1.209 | 1.225 | 0,02 |
| **Meritage Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,172 % fällig am 25.11.2035 | | 1.457 | 1.430 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,672 % fällig am 25.11.2035 | | 2.074 | 1.968 | 0,03 |
| 1,904 % fällig am 25.10.2035 | | 141 | 137 | 0,00 |
| 2,496 % fällig am 25.02.2035 | | 4.440 | 4.466 | 0,06 |
| 2,573 % fällig am 25.06.2035 | | 2.394 | 2.342 | 0,03 |
| **Merrill Lynch-CFC Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,485 % fällig am 12.03.2051 | | 200 | 205 | 0,00 |
| **Money Partners Securities 4 PLC** | | | | |
| 0,963 % fällig am 15.03.2040 | £ | 8.503 | 11.764 | 0,16 |
| **Moorgate Funding Ltd.** | | | | |
| 1,402 % fällig am 15.10.2050 | | 16.505 | 23.785 | 0,33 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,742 % fällig am 25.11.2035 | $ | 3.516 | 3.473 | 0,05 |
| 1,127 % fällig am 25.07.2035 | | 3.000 | 2.825 | 0,04 |
| 1,397 % fällig am 25.04.2035 | | 4.000 | 3.759 | 0,05 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,692 % fällig am 15.04.2049 | | 25.138 | 25.807 | 0,36 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.08.2035 | | 847 | 824 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 5,794 % fällig am 12.08.2045 | | 1.709 | 1.757 | 0,02 |
| **NACC Reperforming Loan REMIC Trust (f)** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.10.2034 | | 1.244 | 1.266 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 25.03.2034 | | 1.448 | 1.420 | 0,02 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.05.2036 | | 247 | 186 | 0,00 |
| 0,932 % fällig am 25.07.2035 | | 6.000 | 5.466 | 0,08 |
| 0,932 % fällig am 25.09.2035 | | 10.500 | 9.548 | 0,13 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,291 % fällig am 25.02.2035 | | 4.000 | 3.524 | 0,05 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035 (f) | | 4.976 | 5.079 | 0,07 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,802 % fällig am 25.12.2035 | | 3.607 | 3.235 | 0,05 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.01.2036 | | 1.751 | 1.709 | 0,02 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | | 9.400 | 8.469 | 0,12 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | | 11.700 | 10.987 | 0,15 |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | | 8.100 | 7.614 | 0,11 |
| **Permanent Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,351 % fällig am 15.07.2042 | € | 300 | 326 | 0,00 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 0,822 % fällig am 25.02.2034 | $ | 441 | 418 | 0,01 |
| **Provident Funding Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,611 % fällig am 25.08.2033 | | 25 | 26 | 0,00 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.07.2037 | | 646 | 655 | 0,01 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 1,022 % fällig am 25.11.2034 | | 228 | 197 | 0,00 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 0,561 % fällig am 25.06.2035 | | 529 | 464 | 0,01 |
| 5,543 % fällig am 25.01.2034 | | 33 | 33 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 | | 164 | 170 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.01.2034 | | 3.660 | 3.770 | 0,05 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.11.2035 | | 8.000 | 7.324 | 0,10 |
| 1,097 % fällig am 25.02.2035 | | 1.120 | 1.071 | 0,02 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,812 % fällig am 25.02.2036 | | 6.700 | 6.377 | 0,09 |
| **Residential Asset Securitization Trust (f)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 2.957 | 2.023 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 | | 1.108 | 806 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,808 % fällig am 25.02.2036 (f) | $ | 580 | $ 529 | 0,01 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC** | | | | |
| 0,925 % fällig am 12.12.2043 | £ | 5.956 | 8.077 | 0,11 |
| **ResLoC UK PLC** | | | | |
| 0,743 % fällig am 15.12.2043 | | 8.471 | 11.309 | 0,16 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.12.2035 | $ | 1.705 | 1.662 | 0,02 |
| 1,397 % fällig am 25.03.2035 | | 3.208 | 3.063 | 0,04 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.05.2035 | | 2.093 | 1.970 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,540 % fällig am 25.09.2034 | | 2.756 | 2.741 | 0,04 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.03.2036 | | 3.748 | 3.334 | 0,05 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.09.2047 | | 26.110 | 19.889 | 0,28 |
| 0,632 % fällig am 25.09.2047 (f) | | 8.487 | 5.890 | 0,08 |
| 0,642 % fällig am 25.09.2047 | | 40.075 | 32.189 | 0,45 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | | 1.342 | 1.307 | 0,02 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2036 (f) | | 1.859 | 1.450 | 0,02 |
| 0,882 % fällig am 19.04.2035 | | 1.450 | 1.351 | 0,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 19.09.2032 | | 149 | 146 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,762 % fällig am 25.02.2036 | | 6.000 | 5.420 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036 (f) | | 1.075 | 983 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,339 % fällig am 25.01.2032 | | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,488 % fällig am 25.06.2033 | | 36 | 36 | 0,00 |
| 2,688 % fällig am 25.02.2032 | | 74 | 73 | 0,00 |
| **Taurus Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,650 % fällig am 22.04.2028 | € | 8.800 | 9.564 | 0,13 |
| **Taurus IT Srl** | | | | |
| 1,414 % fällig am 18.02.2027 | | 18.368 | 19.753 | 0,27 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,084 % fällig am 25.06.2047 (f) | $ | 8.400 | 7.514 | 0,10 |
| 2,376 % fällig am 25.09.2037 | | 23.990 | 23.759 | 0,33 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 9.800 | 14.325 | 0,20 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,374 % fällig am 15.06.2049 | $ | 2.600 | 2.567 | 0,04 |
| 5,342 % fällig am 15.12.2043 | | 11.345 | 11.612 | 0,16 |
| 5,509 % fällig am 15.04.2047 | | 400 | 411 | 0,01 |
| **WaMu Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,449 % fällig am 23.03.2045 | | 10.835 | 10.972 | 0,15 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2045 | | 20.939 | 19.750 | 0,27 |
| 0,712 % fällig am 25.10.2045 | | 16.191 | 15.035 | 0,21 |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | | 269 | 253 | 0,00 |
| 1,643 % fällig am 25.08.2042 | | 452 | 431 | 0,01 |
| 2,165 % fällig am 25.09.2036 | | 52 | 46 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust (f)** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.05.2035 | | 1.941 | 1.537 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 | | 2.429 | 2.154 | 0,03 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,770 % fällig am 25.02.2031 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,012 % fällig am 25.11.2035 | | 4.200 | 3.866 | 0,05 |
| 1,052 % fällig am 25.03.2035 | | 7.000 | 6.264 | 0,09 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,699 % fällig am 25.07.2034 | | 258 | 258 | 0,00 |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 | | 3.777 | 3.761 | 0,05 |
| 2,807 % fällig am 25.01.2035 | | 5.767 | 5.747 | 0,08 |
| | | | 987.312 | 13,67 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **BlackRock Senior Income** | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.04.2019 | | 2.077 | 2.072 | 0,03 |
| **Bosphorus CLO** | | | | |
| 1,077 % fällig am 10.11.2023 | € | 6.780 | 7.344 | 0,10 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 1,350 % fällig am 27.11.2028 | | 10.000 | 10.863 | 0,15 |
| **EFS Volunteer No.2 LLC** | | | | |
| 1,101 % fällig am 26.07.2027 | $ | 16.813 | $ 16.582 | 0,23 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 2.142 | 2.316 | 0,03 |
| **Lockwood Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 1,690 % fällig am 25.01.2024 | $ | 6.300 | 6.278 | 0,09 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 1,270 % fällig am 25.04.2038 | | 29 | 29 | 0,00 |
| **Mountain View Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 0,581 % fällig am 15.04.2019 | | 3.452 | 3.434 | 0,05 |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | | |
| 3,190 % fällig am 18.03.2026 | | 4.800 | 4.776 | 0,07 |
| **Panther CDO V BV** | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | € | 7.947 | 8.298 | 0,11 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,981 % fällig am 16.12.2019 | $ | 284 | 284 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,450 % fällig am 25.01.2019 | | 1.268 | 1.259 | 0,02 |
| 1,820 % fällig am 25.04.2023 | | 430 | 431 | 0,00 |
| **Sunrise Srl** | | | | |
| 0,616 % fällig am 27.11.2031 | € | 45.673 | 49.655 | 0,69 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 1,655 % fällig am 17.07.2024 | $ | 10.000 | 9.945 | 0,14 |
| **Wood Street CLO 1 BV** | | | | |
| 0,231 % fällig am 22.11.2021 | € | 3.357 | 3.636 | 0,05 |
| 0,361 % fällig am 22.11.2021 | | 7.600 | 8.113 | 0,11 |
| | | | 135.315 | 1,87 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | $ | 7.800 | 7.742 | 0,11 |
| 6,369 % fällig am 16.06.2018 | | 5.000 | 4.937 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 10.06.2019 | | 500 | 491 | 0,01 |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.01.2021 | | 32.300 | 34.480 | 0,48 |
| 5,125 % fällig am 29.06.2020 | | 5.600 | 6.194 | 0,08 |
| **IPIC GMTN Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2017 | | 10.000 | 10.215 | 0,14 |
| 4,875 % fällig am 14.05.2016 | € | 70.600 | 77.855 | 1,08 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.09.2022 | $ | 10.000 | 10.099 | 0,14 |
| 3,250 % fällig am 20.09.2016 | | 2.600 | 2.634 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 22.08.2017 | | 9.500 | 9.749 | 0,13 |
| **Mexico Government International Bond (c)** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 | MXN | 151.235 | 8.889 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 | | 113.561 | 7.210 | 0,10 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 1,650 % fällig am 27.09.2019 | $ | 24.000 | 23.721 | 0,33 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 (b) | CAD | 14.600 | 11.369 | 0,16 |
| 4,000 % fällig am 02.06.2021 (b) | | 63.400 | 51.379 | 0,71 |
| 4,400 % fällig am 14.04.2020 | $ | 22.300 | 24.396 | 0,34 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.08.2021 | | 2.700 | 2.735 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 29.07.2020 | | 4.300 | 4.552 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 (b) | CAD | 10.100 | 8.024 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 (b) | | 34.900 | 28.747 | 0,40 |
| | | | 335.418 | 4,65 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **WANDELBARE VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Motors Liquidation Co.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 06.03.2032 (f) | | 12.000 | 0 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Firstar Realty LLC** | | | | |
| 8,875 % fällig am 31.12.2021 | | 4.000 | 4.939 | 0,07 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 3.260.360 | 327.997 | 4,54 |

| | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 21.712.577 | $ 217.169 | 3,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 10.003.890** | **138,54** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month EURIBOR Interest Rate June Futures | Long | 06/2016 | 700 | $ 19 | 0,00 |
| 3-Month EURIBOR Interest Rate March Futures | Long | 03/2016 | 384 | 5 | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 7.549 | (5.031) | (0,07) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 816 | (232) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 335 | (278) | 0,00 |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 1.071 | (567) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2018 | 1.244 | (1.050) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 2.802 | (1.675) | (0,02) |
| 90-Day Sterling December Futures | Short | 12/2016 | 878 | 143 | 0,00 |
| 90-Day Sterling June Futures | Short | 06/2016 | 123 | (93) | 0,00 |
| 90-Day Sterling June Futures | Short | 06/2017 | 6.565 | (3.238) | (0,05) |
| 90-Day Sterling March Futures | Short | 03/2017 | 3.351 | 157 | 0,00 |
| 90-Day Sterling September Futures | Short | 09/2017 | 260 | 107 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 675 | (1.360) | (0,02) |
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.472 | (334) | (0,01) |
| Euro-Schatz 2-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 706 | 18 | 0,00 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 21 | 7 | 0,00 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 12.782 | (3.890) | (0,05) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 10.955 | 5.341 | 0,07 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 314 | (250) | 0,00 |
| | | | | $ (12.201) | (0,17) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - Euro-Bobl 5-year Note March Futures | € 126,250 | 19.02.2016 | 891 | $ 6 | $ 5 | 0,00 |
| Call - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 142,000 | 19.02.2016 | 1.859 | 16 | 29 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note December Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 7.000 | 60 | 55 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note December Futures | 110,500 | 19.02.2016 | 2.584 | 22 | 20 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note December Futures | 111,000 | 19.02.2016 | 1.202 | 11 | 9 | 0,00 |
| | | | | $ 115 | $ 118 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (12.083)** | **(0,17)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-25 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | $ 54.300 | $ 169 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month Canadian Bank Bill | 2,700 % | 19.12.2024 | CAD 28.200 | $ 268 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 05.08.2025 | $ 100.900 | (2.360) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 139.800 | 469 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 759.900 | (61.670) | (0,85) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 15.06.2046 | 7.700 | (75) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,880 % | 05.10.2017 | £ 94.900 | (119) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | £ 323.800 | $ (3.300) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | 326.400 | (1.772) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 % | 15.06.2018 | 52.700 | 266 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 % | 21.09.2018 | 35.100 | 49 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 21.09.2018 | 30.700 | (26) | 0,00 |
| Erhalt | FEDL01 Index | 0,500 % | 17.06.2016 | $ 185.300 | (209) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,270 % | 05.02.2020 | MXN 7.600 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,608 % | 08.10.2021 | 215.300 | 117 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,430 % | 17.11.2021 | 1.525.400 | 1.634 | 0,02 |
| Erhalt | IBMEXID | 5,940 % | 13.07.2022 | 1.035.500 | 339 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,500 % | 02.09.2022 | 442.300 | 405 | 0,01 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,750 % | 02.09.2022 | 510.000 | (290) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 02.09.2022 | 138.000 | 68 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,975 % | 16.09.2022 | 222.300 | 24 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,750 % | 05.06.2023 | 63.800 | (102) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,000 % | 05.06.2023 | 16.900 | (34) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,470 % | 21.01.2025 | 185.600 | (648) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,530 % | 05.06.2025 | 895.200 | (68) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,025 % | 31.12.2029 | 604.800 | (3.161) | (0,04) |
| Zahlung | IBMEXID | 6,280 % | 01.01.2035 | 350.000 | (1.782) | (0,03) |
| | | | | | $ (71.972) | (0,99) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (71.803)** | **(0,99)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,100 % | 29.01.2016 | $ 463.500 | $ 1.744 | $ 108 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,930 % | 20.08.2018 | 14.500 | 1.539 | 1.303 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,940 % | 20.08.2018 | 12.700 | 1.242 | 1.129 | 0,02 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,100 % | 30.01.2018 | 107.300 | 1.524 | 1.007 | 0,01 |
| Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,800 % | 19.01.2016 | 322.600 | 538 | 6 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,750 % | 29.01.2016 | 54.100 | 838 | 5 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 % | 29.01.2016 | 54.100 | 487 | 16 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,580 % | 12.05.2016 | 45.200 | 1.446 | 321 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,580 % | 23.05.2016 | 105.500 | 2.983 | 823 | 0,01 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,020 % | 21.08.2017 | 27.500 | 1.870 | 1.590 | 0,02 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,910 % | 20.08.2018 | 12.500 | 1.250 | 1.154 | 0,02 |
| | | | | | | | $ 15.461 | $ 7.462 | 0,10 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ 1,082 | 15.01.2016 | € 58.900 | $ (373) | $ (322) | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | CBK | 1,078 | 22.01.2016 | 23.900 | (170) | (150) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | GLM | BRL 4,450 | 14.01.2016 | $ 47.000 | (966) | (24) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,600 | 14.03.2016 | 38.800 | (1.094) | (366) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | DUB | 4,550 | 17.03.2016 | 25.900 | (654) | (300) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SCX | CNH 6,850 | 01.06.2016 | 13.500 | (124) | (154) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Mexican peso | GLM | MXN 17,400 | 05.02.2016 | 26.000 | (254) | (292) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Mexican peso | GLM | 17,650 | 08.03.2016 | 25.900 | (292) | (324) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Mexican peso | HUS | 18,100 | 11.03.2016 | 11.500 | (123) | (82) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | RUB 74,000 | 09.03.2016 | 11.900 | (218) | (418) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | HUS | 87,000 | 08.12.2016 | 13.600 | (584) | (723) | (0,01) |
| Put - OTC US dollar versus Japanese yen | BOA | JPY 80,000 | 18.02.2019 | 5.300 | (296) | (33) | 0,00 |
| | | | | | $ (5.148) | $ (3.188) | (0,04) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,730 % | 29.01.2016 | $ 463.500 | $ (660) | $ 0 | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,915 % | 29.01.2016 | 463.500 | (1.136) | (2) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | 85.600 | (347) | (217) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | GLM | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 % | 20.08.2018 | 119.700 | (2.788) | (2.122) | (0,03) |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,100 % | 30.01.2018 | 107.300 | (558) | (257) | 0,00 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,600 % | 30.01.2018 | 107.300 | (971) | (547) | (0,01) |
| Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,500 % | 19.01.2016 | 214.800 | (129) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,520 % | 19.01.2016 | 107.800 | (65) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,650 % | 19.01.2016 | 214.800 | (236) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 0,660 % | 19.01.2016 | 107.800 | (108) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,100 % | 29.01.2016 | 54.100 | (205) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,300 % | 29.01.2016 | 54.100 | (314) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,900 % | 16.02.2016 | 387.800 | (1.596) | (983) | (0,02) |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 12.05.2016 | 430.000 | (1.448) | (248) | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 23.05.2016 | 1.001.300 | (3.129) | (645) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,700 % | 21.08.2017 | 120.900 | (1.874) | (1.300) | (0,02) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 % | 20.08.2018 | 55.000 | (1.227) | (975) | (0,01) |
| | | | | | | | $ (16.791) | $ (7.297) | (0,10) |

| Beschreibung | Kontrahent | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **INFLATIONSMINIMUM** | | | | | | | | |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | $ 215,949 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 12.03.2020 | $ 20.700 | $ (175) | $ (11) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | 216,687 | Maximal [1-(Index Final/Index Initial) oder $ 0] | 07.04.2020 | 49.700 | (443) | (27) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | CBK | 217,965 | Maximal [1-(Final Index/Initial Index), 0] | 29.09.2020 | 37.100 | (479) | (23) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | DUB | 215,949 | Maximal [(((Index Final/Index Initial)-1)-2,500 %) oder $ 0] | 10.03.2020 | 7.500 | (56) | (4) | 0,00 |
| Minimum - OTC CPURNSA Index | DUB | 218,011 | Maximal [-(Final Index/Initial Index - 1), 0] | 13.10.2020 | 40.100 | (393) | (27) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.546) | $ (92) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Bank Of America Corp. | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | $ 13.400 | $ 181 | $ 43 | $ 138 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2016 | DUB | 9.100 | 58 | 143 | (85) | 0,00 |
| Borgwarner, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 13.500 | (113) | (297) | 184 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BRC | 2.000 | 20 | 20 | 0 | 0,00 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | CBK | 6.000 | 60 | 56 | 4 | 0,00 |
| Citigroup, Inc. | 1,000 % | 20.09.2016 | BOA | 6.500 | 38 | 78 | (40) | 0,00 |
| Export-Import Bank of China | 1,000 % | 20.06.2017 | DUB | 500 | 4 | (21) | 25 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 27.500 | 241 | 101 | 140 | 0,00 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,000 % | 20.12.2020 | BPS | 10.000 | 136 | 59 | 77 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BOA | 19.600 | (550) | (356) | (194) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BRC | 41.900 | (1.176) | (732) | (444) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | CBK | 11.500 | (323) | (209) | (114) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | HUS | 12.900 | (362) | (234) | (128) | 0,00 |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | BPS | 9.200 | (2.651) | (1.382) | (1.269) | (0,04) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | GST | 4.900 | (1.412) | (728) | (684) | (0,02) |
| Petrobras Global Finance BV | 1,000 % | 20.03.2020 | HUS | 14.600 | (4.207) | (2.251) | (1.956) | (0,06) |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.09.2022 | BOA | 3.400 | 64 | 50 | 14 | 0,00 |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.09.2022 | BPS | 11.800 | 221 | 188 | 33 | 0,00 |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.09.2022 | JPM | 20.000 | 374 | 289 | 85 | 0,01 |
| Republik Korea | 1,000 % | 20.09.2022 | MYC | 3.900 | 73 | 59 | 14 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | FBF | € 6.700 | (627) | (646) | 19 | (0,01) |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 % | 20.09.2018 | FBF | $ 11.000 | 173 | 299 | (126) | 0,00 |
| | | | | | $ (9.778) | $ (5.471) | $ (4.307) | (0,14) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MCDX.25-V1 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | $ 6.500 | $ 7 | $ (12) | $ 19 | 0,00 |
| MCDX.25-V1 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 7.500 | 9 | (13) | 22 | 0,00 |
| | | | | | $ 16 | $ (25) | $ 41 | 0,00 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund (Forts.)

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | IBMEXID | 5,500 % | 02.09.2022 | GLM | MXN 70.000 | $ (102) | $ (26) | $ (76) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,500 % | 02.09.2022 | HUS | 391.900 | (570) | (773) | 203 | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 5,750 % | 05.06.2023 | GLM | 8.300 | (10) | (15) | 5 | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,570 % | 19.04.2024 | HUS | 284.700 | 458 | 0 | 458 | 0,01 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 0,435 % | 14.09.2016 | BOA | $ 12.500 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| Erhalt | US CPI Urban Consumers NSA | 0,415 % | 23.09.2016 | BOA | 27.400 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | | | | | | $ (116) | $ (814) | $ 698 | 0,00 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz[1] | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | Fannie Mae | 47.037 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 10.348 | 12.01.2044 | FBF | $ 81 | $ 0 | $ 81 | 0,00 |

[1] Der variable Zinssatz basiert auf vorgegebenen Nennbeträgen, die einem Vielfachen der veröffentlichten Anzahl an Anteilen oder Einheiten entsprechen kann.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | BRL | 34.380 | $ | 9.045 | BOA | $ 355 | $ 0 | $ 355 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.781 | BRL | 34.380 | BOA | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| 01/2016 | | 24.033 | | 92.907 | BPS | 0 | (549) | (549) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 92.907 | $ | 23.793 | BPS | 309 | 0 | 309 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.491 | BRL | 5.964 | BRC | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 5.964 | $ | 1.527 | BRC | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.500 | BRL | 35.958 | CBK | 0 | (411) | (411) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 35.958 | $ | 9.209 | CBK | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| 01/2016 | | 476.495 | | 126.021 | DUB | 5.580 | 0 | 5.580 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 122.488 | BRL | 476.495 | DUB | 0 | (2.047) | (2.047) | (0,03) |
| 01/2016 | | 15.966 | | 61.942 | GLM | 0 | (309) | (309) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 61.942 | $ | 15.863 | GLM | 206 | 0 | 206 | 0,00 |
| 01/2016 | | 26.989 | | 6.752 | HUS | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.912 | BRL | 26.989 | HUS | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.750 | | 21.839 | MSB | 0 | (230) | (230) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 21.839 | $ | 5.593 | MSB | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| 01/2016 | | 19.866 | | 5.088 | RYL | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.918 | BRL | 19.866 | RYL | 103 | 0 | 103 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 4.804 | $ | 1.230 | TOR | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.226 | BRL | 4.804 | TOR | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 178 | $ | 128 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 170.835 | | 128.336 | MSB | 5.353 | 0 | 5.353 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 123.889 | CAD | 165.224 | SCX | 0 | (4.946) | (4.946) | (0,07) |
| 01/2016 | CNH | 64.210 | $ | 9.782 | CBK | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12.000 | CNH | 77.602 | DUB | 0 | (236) | (236) | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.370 | | 73.348 | JPM | 0 | (251) | (251) | 0,00 |
| 01/2016 | | 10.589 | | 68.484 | MSB | 0 | (207) | (207) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.454 | | 62.060 | SCX | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| 01/2016 | CNY | 25.998 | $ | 3.972 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.067 | CNY | 25.998 | DUB | 0 | (95) | (95) | 0,00 |
| 01/2016 | DKK | 26.690 | $ | 4.026 | JPM | 141 | 0 | 141 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.282 | € | 1.180 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.018 | | 933 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 642 | $ | 706 | MSB | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 43 | € | 40 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.429 | | 2.227 | RBC | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 1 | $ | 1 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 680 | € | 642 | SOG | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 01/2016 | | 14 | £ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 233.459 | $ | 352.710 | CBK | 8.614 | 0 | 8.614 | 0,12 |
| 01/2016 | $ | 10 | £ | 7 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2 | | 2 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 345.795 | | 233.649 | SCX | 0 | (1.420) | (1.420) | (0,02) |
| 01/2016 | £ | 190 | $ | 283 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.874 | INR | 391.184 | BOA | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 317.130 | $ | 4.772 | UAG | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 703.400 | | 5.794 | CBK | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.228 | JPY | 644.600 | CBK | 131 | 0 | 131 | 0,00 |
| 01/2016 | | 191.561 | | 23.439.500 | GLM | 3.289 | 0 | 3.289 | 0,05 |
| 01/2016 | JPY | 57.959.020 | $ | 473.118 | GLM | 0 | (8.689) | (8.689) | (0,12) |
| 01/2016 | $ | 308.416 | JPY | 37.317.620 | MSB | 1.801 | 0 | 1.801 | 0,02 |
| 01/2016 | JPY | 5.043.000 | $ | 41.575 | MSB | 0 | (347) | (347) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.904.300 | | 23.662 | UAG | 0 | (481) | (481) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 42.647 | JPY | 5.208.000 | UAG | 647 | 0 | 647 | 0,01 |
| 01/2016 | KRW | 6.835.363 | $ | 6.025 | BOA | 211 | 0 | 211 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.591.758 | | 1.388 | CBK | 34 | 0 | 34 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 9.211 | KRW | 10.767.832 | DUB | $ 0 | $ (53) | $ (53) | 0,00 |
| 01/2016 | | 9.502 | | 11.105.464 | DUB | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 21.065.256 | $ | 18.172 | DUB | 256 | 0 | 256 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 18.422 | KRW | 21.507.289 | GLM | 0 | (130) | (130) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 28.532.782 | $ | 24.880 | GLM | 613 | 0 | 613 | 0,01 |
| 01/2016 | | 7.482.527 | | 6.574 | HUS | 210 | 0 | 210 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.993 | KRW | 2.310.884 | HUS | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 18.932.988 | $ | 16.317 | JPM | 214 | 0 | 214 | 0,00 |
| 01/2016 | | 11.105.464 | | 9.725 | JPM | 279 | 0 | 279 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.970 | KRW | 9.246.356 | JPM | 0 | (106) | (106) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.192 | | 3.709.104 | NGF | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| 01/2016 | | 27.823 | | 32.562.917 | UAG | 0 | (128) | (128) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 39.991 | $ | 9.322 | AZD | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50.303 | | 11.655 | BOA | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 01/2016 | | 40.212 | | 9.178 | CBK | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| 01/2016 | | 25.753 | | 6.027 | CBK | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.435 | MYR | 14.602 | DUB | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| 01/2016 | | 6.191 | | 26.322 | GLM | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 13.281 | $ | 3.122 | GLM | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 01/2016 | | 26.472 | | 6.371 | JPM | 234 | 0 | 234 | 0,00 |
| 01/2016 | | 71.106 | | 16.841 | SCX | 357 | 0 | 357 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 5.001 | MYR | 21.349 | SCX | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 32.437 | $ | 7.674 | UAG | 154 | 0 | 154 | 0,00 |
| 01/2016 | | 78.317 | | 18.368 | UAG | 205 | 0 | 205 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.911 | NZD | 16.310 | GLM | 254 | 0 | 254 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 16.310 | $ | 10.660 | SCX | 0 | (506) | (506) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 4.627 | PHP | 216.493 | CBK | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| 01/2016 | PHP | 301.457 | $ | 6.401 | GLM | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.044 | PHP | 96.405 | UAG | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.456 | RUB | 840.952 | BRC | 0 | (994) | (994) | (0,01) |
| 01/2016 | RUB | 51.422 | $ | 714 | JPM | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | SGD | 2 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SGD | 62 | $ | 43 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 101 | SGD | 142 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | THB | 401.247 | $ | 11.109 | BRC | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| 01/2016 | | 380.641 | | 10.547 | NGF | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | TWD | 366.686 | | 11.155 | GLM | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 01/2016 | | 381.164 | | 11.582 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | BRL | 62.548 | | 15.807 | DUB | 157 | 0 | 157 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.264 | BRL | 16.780 | DUB | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.682 | | 26.989 | HUS | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 472 | $ | 344 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 208 | | 149 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 870 | | 654 | JPM | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.382 | CAD | 3.159 | JPM | 0 | (107) | (107) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 703 | $ | 528 | MSB | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 02/2016 | | 185 | | 138 | SCX | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF | 11.757 | | 11.776 | DUB | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 20.843 | CHF | 21.246 | JPM | 417 | 0 | 417 | 0,01 |
| 02/2016 | CHF | 24.696 | $ | 24.736 | JPM | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 10.757 | CHF | 10.681 | MSB | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.858 | DKK | 26.705 | JPM | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 128.697 | $ | 139.305 | BOA | 0 | (629) | (629) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 508.533 | € | 474.530 | CBK | 7.652 | (219) | 7.433 | 0,10 |
| 02/2016 | € | 26.857 | $ | 29.315 | CBK | 122 | (9) | 113 | 0,00 |
| 02/2016 | | 113.208 | | 152.344 | DUB | 29.282 | 0 | 29.282 | 0,41 |
| 02/2016 | | 15.984 | | 17.415 | GLM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 02/2016 | | 121.516 | | 131.568 | JPM | 122 | (681) | (559) | (0,01) |
| 02/2016 | $ | 26.044 | € | 23.833 | JPM | 40 | (170) | (130) | 0,00 |
| 02/2016 | | 14.276 | | 13.424 | MSB | 328 | (8) | 320 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 2.378 | $ | 2.525 | SCX | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.483 | £ | 5.654 | CBK | 0 | (149) | (149) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 2.715 | $ | 4.109 | CBK | 107 | 0 | 107 | 0,00 |
| 02/2016 | | 21.409 | | 32.307 | JPM | 749 | 0 | 749 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 2.183 | £ | 1.472 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.686 | | 6.475 | JPM | 0 | (142) | (142) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 900 | $ | 1.360 | MSB | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 02/2016 | | 233.649 | | 345.822 | SCX | 1.419 | 0 | 1.419 | 0,02 |
| 02/2016 | HKD | 12.114 | | 1.564 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 7.400 | ILS | 28.666 | BOA | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | | 17.954 | | 69.633 | BPS | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.873 | | 26.680 | BRC | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.994 | | 15.537 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 7.493 | | 29.064 | DUB | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.584 | | 13.707 | JPM | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.697 | | 22.052 | MSB | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.128 | | 16.080 | RYL | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | | 31.731 | | 122.736 | SOG | 0 | (163) | (163) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 343.663 | $ | 88.220 | UAG | 0 | (172) | (172) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 42.758 | JPY | 5.255.400 | CBK | 966 | 0 | 966 | 0,01 |
| 02/2016 | | 651 | | 80.142 | JPM | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 1.421.500 | $ | 11.540 | JPM | 0 | (287) | (287) | 0,00 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | JPY 37.317.620 | $ 308.591 | MSB | $ 0 | $ (1.823) | $ (1.823) | (0,03) |
| 02/2016 | $ 83.402 | JPY 10.201.200 | UAG | 1.470 | 0 | 1.470 | 0,02 |
| 02/2016 | MYR 12.562 | $ 2.942 | JPM | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 02/2016 | NZD 16.310 | 10.886 | GLM | 0 | (252) | (252) | 0,00 |
| 02/2016 | $ 11.729 | NZD 18.083 | SCX | 620 | 0 | 620 | 0,01 |
| 02/2016 | SGD 8.929 | $ 6.266 | BOA | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | 4.395 | 3.127 | GLM | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 02/2016 | 26.325 | 18.637 | JPM | 113 | 0 | 113 | 0,00 |
| 02/2016 | 8.840 | 6.279 | SCX | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| 02/2016 | 13.011 | 9.189 | SOG | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| 02/2016 | THB 405.906 | 11.291 | FBF | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | 254.232 | 7.022 | HUS | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | 226.041 | 6.265 | SCX | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | $ 5.991 | THB 215.291 | UAG | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD 419.993 | $ 12.762 | BRC | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| 02/2016 | 209.821 | 6.415 | DUB | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 6.538 | TWD 213.872 | DUB | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD 34.856 | $ 1.063 | GLM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | 34.867 | 1.064 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | 147.019 | 4.505 | UAG | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 9.146 | MXN 157.373 | BOA | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN 99.350 | $ 5.812 | BPS | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 57.662 | MXN 995.133 | BRC | 0 | (333) | (333) | 0,00 |
| 03/2016 | 35.480 | 613.680 | CBK | 0 | (126) | (126) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN 44.079 | $ 2.552 | GLM | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 2.769 | MXN 47.976 | GLM | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 03/2016 | 2.529 | 43.186 | JPM | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN 2.207.348 | $ 126.637 | JPM | 0 | (528) | (528) | (0,01) |
| 03/2016 | $ 15.431 | MXN 266.780 | UAG | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| 03/2016 | MXN 141.855 | $ 8.257 | UAG | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| 03/2016 | $ 33.184 | RUB 2.363.051 | BOA | 0 | (1.537) | (1.537) | (0,02) |
| 03/2016 | 5.181 | 372.514 | DUB | 0 | (192) | (192) | 0,00 |
| 03/2016 | 6.978 | 510.248 | FBF | 0 | (144) | (144) | 0,00 |
| 03/2016 | 3.941 | 290.136 | GLM | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| 03/2016 | 3.214 | 237.095 | JPM | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| 04/2016 | DKK 26.690 | $ 3.917 | HUS | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 04/2016 | $ 698 | RUB 51.422 | JPM | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| 05/2016 | 10.855 | MYR 46.731 | CBK | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| 05/2016 | 2.746 | 11.714 | DUB | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| 05/2016 | 492 | 2.084 | HUS | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 05/2016 | 879 | 3.757 | SOG | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 06/2016 | € 37.475 | $ 51.596 | BOA | 10.678 | 0 | 10.678 | 0,15 |
| 06/2016 | $ 14.848 | € 10.994 | BOA | 0 | (2.849) | (2.849) | (0,04) |
| 06/2016 | € 232.335 | $ 317.654 | BOA | 64.090 | 0 | 64.090 | 0,89 |
| 06/2016 | 41.469 | 57.022 | BRC | 11.743 | 0 | 11.743 | 0,16 |
| 06/2016 | 22.932 | 31.398 | DUB | 6.371 | 0 | 6.371 | 0,09 |
| 06/2016 | $ 21.645 | € 16.014 | DUB | 0 | (4.167) | (4.167) | (0,06) |
| 06/2016 | € 58.340 | $ 80.238 | MSB | 16.567 | 0 | 16.567 | 0,23 |
| 06/2016 | 64.106 | 87.844 | NAB | 17.881 | 0 | 17.881 | 0,25 |
| 06/2016 | 62.701 | 86.271 | NAB | 17.809 | 0 | 17.809 | 0,25 |
| 07/2016 | 81.280 | 110.264 | NAB | 21.410 | 0 | 21.410 | 0,30 |
| 09/2016 | CNH 19.756 | 2.996 | JPM | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| 09/2016 | 78.043 | 11.895 | JPM | 338 | 0 | 338 | 0,00 |
| 09/2016 | 143.966 | 21.871 | UAG | 539 | 0 | 539 | 0,01 |
| 10/2016 | 150.658 | 23.000 | HUS | 708 | 0 | 708 | 0,01 |
| 12/2016 | 117.236 | 17.644 | HUS | 365 | 0 | 365 | 0,01 |
| 12/2016 | 203.741 | 30.624 | MSB | 591 | 0 | 591 | 0,01 |
| | | | | $ 243.739 | $ (38.723) | $ 205.016 | 2,84 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 192.104** | **2,66** |
| **Summe Anlagen** | **$ 10.112.108** | **140,04** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 343 | $ 506 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 124 | 124 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 766 | 557 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 739 | 506 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 5 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3.432 | 3.432 | 0,05 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 5 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 6 | 4 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 37 | $ 37 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 1 | 0 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 7 | 5 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 28 | 19 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.070 | 1.070 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 2 | 2 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 5 | 3 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1.031 | 1.031 | 0,01 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 449 | 327 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 1 | 0 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 207 | 149 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2.019 | 2.193 | 0,03 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 108 | 160 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 24 | 24 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 10.158** | **0,14** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (2.901.138)** | **(40,18)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 7.221.128** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

(a) **Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 436.843 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 71.294 und Barmittel in Höhe von USD 6.024 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 18.851 und Barmittel in Höhe von USD 2.369 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(f) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(g) **Zum 31. Dezember 2015 wurden Barmittel mit einem Gesamtwert von USD 3.867 als Sicherheit für verzögert gelieferte Wertpapiere verpfändet.**

(h) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 11.120 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(i) **Bewertung zum Marktwert[1].**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 583.821 | $ 9.395.267 | $ 24.802 | $ 10.003.890 |
| Finanzderivate[3] | (12.083) | 120.301 | 0 | 108.218 |
| **Summen** | **$ 571.738** | **$ 9.515.568** | **$ 24.802** | **$ 10.112.108** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.010.059 | $ 11.250.803 | $ 41.910 | $ 12.302.772 |
| Finanzderivate[3] | 21.125 | 60.353 | 0 | 81.478 |
| **Summen** | **$ 1.031.184** | **$ 11.311.156** | **$ 41.910** | **$ 12.384.250** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(j) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CAD | 25.307 | $ | 18.516 | BOA | $ 298 | $ 0 | $ 298 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 403 | CAD | 562 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 182 | $ | 131 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 12.329 | | 9.100 | CBK | 224 | 0 | 224 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 24.124 | CAD | 32.232 | HUS | 0 | (920) | (920) | (0,01) |
| 01/2016 | CAD | 12.954 | $ | 9.321 | HUS | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 24.189 | CAD | 32.232 | JPM | 0 | (985) | (985) | (0,01) |
| 01/2016 | CAD | 14.785 | $ | 10.618 | MSB | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 23.609 | CAD | 31.427 | MSB | 0 | (985) | (985) | (0,01) |
| 01/2016 | | 21.293 | | 28.456 | SCX | 0 | (808) | (808) | (0,01) |
| 01/2016 | CAD | 14.863 | $ | 10.727 | SOG | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 01/2016 | | 45.000 | | 32.412 | UAG | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 10.703 | CAD | 14.863 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.322 | | 12.954 | HUS | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | | 10.619 | | 14.785 | MSB | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 351 | $ | 254 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 10.728 | CAD | 14.863 | SOG | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | | | | | | $ 597 | $ (3.758) | $ (3.161) | (0,04) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 6.826 | CHF | 7.009 | BOA | $ 175 | $ 0 | $ 175 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF | 10 | $ | 10 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 200 | | 196 | BPS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 101 | | 101 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.303 | | 8.399 | CBK | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| 01/2016 | | 147 | | 146 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.939 | CHF | 8.106 | DUB | 159 | 0 | 159 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 66 | $ | 64 | FBF | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.931 | CHF | 8.100 | JPM | 162 | 0 | 162 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 9.322 | $ | 9.438 | JPM | 125 | 0 | 125 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 331 | CHF | 327 | MSB | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 5.664 | $ | 5.717 | MSB | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| 01/2016 | | 22 | | 23 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 7.977 | CHF | 8.101 | UAG | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF | 8.079 | $ | 8.179 | UAG | 108 | 0 | 108 | 0,00 |
| 02/2016 | | 76 | | 77 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 8.213 | CHF | 8.109 | CBK | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.450 | | 9.322 | JPM | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| 02/2016 | | 5.586 | | 5.527 | MSB | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| 02/2016 | | 8.188 | | 8.079 | UAG | 0 | (107) | (107) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.009 | $ (403) | $ 606 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 647.033 | $ | 710.653 | BOA | $ 7.979 | $ (198) | $ 7.781 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 697.052 | € | 653.781 | BOA | 13.151 | 0 | 13.151 | 0,18 |
| 01/2016 | | 1.294 | | 1.217 | BPS | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 9.801 | $ | 10.735 | BPS | 87 | 0 | 87 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.208 | | 8.916 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1.059 | € | 975 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 39.385 | $ | 42.621 | CBK | 163 | (325) | (162) | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.108 | | 3.324 | DUB | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 438.568 | € | 413.909 | GLM | 11.062 | 0 | 11.062 | 0,15 |
| 01/2016 | € | 638.321 | $ | 701.479 | HUS | 8.071 | 0 | 8.071 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 697.405 | € | 654.426 | HUS | 13.497 | 0 | 13.497 | 0,19 |
| 01/2016 | € | 383.494 | $ | 419.070 | JPM | 2.480 | 0 | 2.480 | 0,03 |
| 01/2016 | | 4.129 | | 4.391 | NAB | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.613 | | 2.850 | RBC | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.427 | | 3.754 | SCX | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 29 | € | 27 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 658.621 | $ | 719.103 | UAG | 3.900 | (256) | 3.644 | 0,05 |
| 01/2016 | $ | 704.254 | € | 662.521 | UAG | 15.442 | 0 | 15.442 | 0,21 |
| 02/2016 | | 701.885 | | 638.321 | BOA | 0 | (7.985) | (7.985) | (0,11) |
| 02/2016 | € | 6.217 | $ | 6.831 | BOA | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 701.977 | € | 638.321 | HUS | 0 | (8.077) | (8.077) | (0,11) |
| 02/2016 | | 419.356 | | 383.494 | JPM | 0 | (2.471) | (2.471) | (0,03) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € | 27 | $ | 29 | SCX | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 701.689 | € | 641.943 | UAG | 0 | (3.852) | (3.852) | (0,05) |
| | | | | | | $ 75.976 | $ (23.310) | $ 52.666 | 0,73 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ | 400 | $ | 603 | AZD | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| 01/2016 | | 642 | | 965 | BOA | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 1 | £ | 0 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 34.022 | | 22.607 | BPS | 0 | (701) | (701) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 122 | $ | 184 | BPS | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | | 207 | | 305 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 39.239 | £ | 25.972 | CBK | 0 | (958) | (958) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 28.005 | $ | 41.593 | CBK | 316 | 0 | 316 | 0,00 |
| 01/2016 | | 171 | | 256 | DUB | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 39.207 | £ | 26.008 | DUB | 0 | (874) | (874) | (0,01) |
| 01/2016 | | 4.488 | | 2.960 | JPM | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 25.554 | $ | 37.922 | JPM | 258 | 0 | 258 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 39.272 | £ | 26.049 | MSB | 0 | (879) | (879) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 25.554 | $ | 37.832 | MSB | 168 | 0 | 168 | 0,00 |
| 01/2016 | | 64 | | 94 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 23.399 | | 34.630 | SCX | 142 | 0 | 142 | 0,00 |
| 01/2016 | | 113 | | 172 | UAG | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 39.060 | £ | 26.319 | CBK | 0 | (265) | (265) | (0,01) |
| 02/2016 | | 37.923 | | 25.554 | JPM | 0 | (256) | (256) | 0,00 |
| 02/2016 | | 37.835 | | 25.554 | MSB | 0 | (168) | (168) | 0,00 |
| 02/2016 | | 34.633 | | 23.399 | SCX | 0 | (142) | (142) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 2.827 | $ | 4.216 | UAG | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | | | | | | $ 978 | $ (4.368) | $ (3.390) | (0,05) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional ILS (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | ILS | 27 | $ | 7 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 846 | ILS | 3.282 | BPS | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 4 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 845 | ILS | 3.277 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 275 | | 1.068 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 443 | | 1.715 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 847 | | 3.277 | SOG | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 3.305 | JPY | 405.567 | BOA | $ 66 | $ 0 | $ 66 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 4.090 | $ | 34 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 35.897 | | 298 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.902 | JPY | 477.771 | DUB | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 141.220 | $ | 1.172 | DUB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 163.053 | | 1.349 | GLM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.320 | JPY | 405.567 | GLM | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.248 | | 274.816 | JPM | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 406.819 | $ | 3.380 | JPM | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | | 407.625 | | 3.369 | MSB | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 01/2016 | | 409.106 | | 3.399 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 298 | JPY | 35.897 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.173 | | 141.220 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.349 | | 163.053 | GLM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.382 | | 406.819 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.371 | | 407.625 | MSB | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.383 | | 406.887 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 255 | $ (32) | $ 223 | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SGD (Hedged) Class und Class E SGD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 49 | SGD | 70 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 50 | | 71 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SGD | 159 | $ | 112 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 102 | | 72 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 143 | | 101 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 203 | SGD | 286 | BOA | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | | 120 | | 169 | BRC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 147 | $ | 104 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 75 | SGD | 106 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.430 | $ | 1.011 | CBK | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 13.110 | SGD | 18.583 | DUB | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | | 25.539 | | 36.027 | HUS | 0 | (188) | (188) | 0,00 |
| 02/2016 | | 3 | | 4 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 401 | $ | 284 | JPM | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 25.660 | SGD | 36.126 | SCX | 0 | (239) | (239) | (0,01) |
| | | | | | | $ 7 | $ (463) | $ (456) | (0,01) |

**(k) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged), Class S EUR (Hedged) und Class T EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 150.176 | $ 163.895 | $ (626) | $ 0 | $ (626) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(l) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,700 % | 27.11.2015 | 08.01.2016 | $ 78.698 | $ (78.752) | (1,09) |
| BRC | (2,000 %) | 24.11.2015 | 23.11.2017 | 1.173 | (1.171) | (0,02) |
| BRC | (1,750 %) | 17.12.2015 | 16.12.2017 | 574 | (574) | (0,01) |
| GRE | 0,400 % | 25.11.2015 | 15.01.2016 | 4.606 | (4.608) | (0,06) |
| GRE | 0,900 % | 04.12.2015 | 15.01.2016 | 86.455 | (86.516) | (1,20) |
| IND | 0,470 % | 19.11.2015 | 20.01.2016 | 142.434 | (142.514) | (1,97) |
| IND | 0,550 % | 04.12.2015 | 15.01.2016 | 6.443 | (6.446) | (0,09) |
| JML | (0,500 %) | 28.09.2015 | 23.09.2017 | 4.470 | (4.465) | (0,06) |
| JML | (0,250 %) | 19.11.2015 | 21.10.2017 | 1.615 | (1.614) | (0,02) |
| JPS | 0,470 % | 03.12.2015 | 14.01.2016 | 9.761 | (9.764) | (0,14) |
| | | | | | $ (336.424) | (4,66) |

**(m) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| RBC | | | | CAD | | |
| | 0,688 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 39.659 | $ (28.583) | (0,39) |
| RBC | 0,689 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 25.046 | (18.051) | (0,25) |
| RBC | 0,691 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 70.952 | (51.136) | (0,71) |
| RBC | 0,694 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 11.034 | (7.952) | (0,11) |
| RBC | 0,697 % | 23.11.2015 | 05.01.2016 | 15.653 | (11.280) | (0,16) |
| | | | | | $ (117.002) | (1,62) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 37 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(n) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 65 | $ 0 | $ 65 |
| BOA | 83.347 | (84.720) | (1.373) |
| BPS | (3.075) | 2.710 | (365) |
| BRC | 9.281 | (8.790) | 491 |
| CBK | 15.240 | (14.880) | 360 |
| DUB | 33.422 | (37.278) | (3.856) |
| FBF | (857) | 700 | (157) |
| GLM | 5.018 | (13.690) | (8.672) |
| GST | (1.222) | 1.010 | (212) |
| HUS | 8.040 | (12.120) | (4.080) |
| JPM | 111 | 0 | 111 |
| MSB | 20.204 | (20.280) | (76) |
| MYC | (164) | 80 | (84) |
| NAB | 57.006 | (55.640) | 1.366 |
| NGF | (65) | 0 | (65) |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| RYL | 177 | (70) | 107 |
| SCX | (5.747) | 5.690 | (57) |
| SOG | (545) | 560 | 15 |
| TOR | 4 | 0 | 4 |
| UAG | 17.715 | (22.170) | (4.455) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(o) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 138,54 | 118,10 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,17) | 0,20 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,99) | (0,75) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 2,66 | 1,33 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Total Return Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 372.284.176 | $ 3.725.037 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Bonds | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2030 | $ | 306.400 | 464.833 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2024 | | 448.200 | 455.927 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 251.900 | 250.450 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 206.250 | 203.918 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 | | 196.400 | 199.701 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,750 % fällig am 30.09.2022 | | 183.400 | 182.815 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 4,375 % fällig am 15.11.2039 | | 102.400 | 141.124 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 141.000 | 138.613 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 | | 98.000 | 96.254 |
| Mexico Government International Bond | | | |
| 6,500 % fällig am 10.06.2021 | MXN | 1.500.000 | 91.385 |
| Bundesrepublik Deutschland | | | |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 | € | 46.100 | 86.620 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2024 | $ | 79.000 | 82.909 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2042 | | 73.000 | 80.036 |
| Spain Government Bond | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 56.100 | 69.986 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,750 % fällig am 15.11.2042 | $ | 69.100 | 69.437 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2039 | | 50.700 | 68.020 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 46.300 | 65.136 |
| Japan Treasury Bills | | | |
| (0,035)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 7.670.000 | 64.295 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 4,500 % fällig am 15.08.2039 | $ | 44.600 | 62.068 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 408.148.509 | $ 4.084.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Bonds | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2030 | $ | 306.400 | 458.105 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2024 | | 455.100 | 456.775 |
| Freddie Mac | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2022 | | 300.600 | 306.774 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 218.484 | 259.746 |
| US Treasury Notes | | | |
| 0,750 % fällig am 31.10.2017 | | 255.300 | 253.777 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | | 251.900 | 245.613 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2023 | € | 156.400 | 225.217 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ | 206.250 | 203.491 |
| Freddie Mac | | | |
| 1,250 % fällig am 02.10.2019 | | 201.800 | 200.082 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 | | 168.700 | 173.625 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 121.800 | 171.297 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 72.800 | 96.986 |
| Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010 | | | |
| 7,625 % fällig am 01.03.2040 | $ | 60.900 | 94.322 |
| Mexico Government International Bond | | | |
| 6,500 % fällig am 10.06.2021 | MXN | 1.500.000 | 91.890 |
| Spain Government Bond | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 73.600 | 91.478 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2024 | $ | 79.000 | 83.921 |
| Bundesrepublik Deutschland | | | |
| 4,250 % fällig am 04.07.2039 | € | 46.100 | 82.599 |
| Spain Government Bond | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 56.100 | 71.962 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | | 46.300 | 66.080 |

(a) Der Total Return Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31. Dezember 2015

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | |
| American Express Credit Corp. | | | |
| 1,552 % fällig am 14.09.2020 | $ 300 | $ 303 | 1,44 |
| Bank of America Corp. | | | |
| 3,875 % fällig am 22.03.2017 | 300 | 307 | 1,45 |
| Bank of Nova Scotia | | | |
| 2,150 % fällig am 03.08.2016 (a) | 1.200 | 1.207 | 5,72 |
| Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | | | |
| 1,522 % fällig am 14.09.2018 | 500 | 502 | 2,38 |
| BBVA Bancomer S.A. | | | |
| 4,500 % fällig am 10.03.2016 | 300 | 302 | 1,43 |
| BOC Aviation Pte Ltd. | | | |
| 2,875 % fällig am 10.10.2017 | 200 | 201 | 0,95 |
| ERP Operating LP | | | |
| 5,375 % fällig am 01.08.2016 | 288 | 295 | 1,40 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | |
| 2,012 % fällig am 29.11.2023 (a) | 500 | 505 | 2,40 |
| HSBC Finance Corp. | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | 400 | 399 | 1,89 |
| ICICI Bank Ltd. | | | |
| 4,750 % fällig am 25.11.2016 | 400 | 410 | 1,94 |
| International Lease Finance Corp. | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | 200 | 214 | 1,01 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | 400 | 401 | 1,90 |
| LeasePlan Corp. NV | | | |
| 2,875 % fällig am 22.01.2019 | 200 | 198 | 0,93 |
| Macquarie Bank Ltd. | | | |
| 5,000 % fällig am 22.02.2017 | 50 | 52 | 0,24 |
| Macquarie Group Ltd. | | | |
| 3,000 % fällig am 03.12.2018 | 400 | 404 | 1,91 |
| Mizuho Bank Ltd. | | | |
| 1,053 % fällig am 25.09.2017 | 300 | 298 | 1,41 |
| National Bank of Canada | | | |
| 2,200 % fällig am 19.10.2016 (a) | 500 | 504 | 2,39 |
| Nomura Holdings, Inc. | | | |
| 2,000 % fällig am 13.09.2016 | 375 | 376 | 1,78 |
| Nordea Eiendomskreditt | | | |
| 2,125 % fällig am 22.09.2016 | 400 | 403 | 1,91 |
| Reliance Standard Life Global Funding II | | | |
| 2,150 % fällig am 15.10.2018 | 200 | 199 | 0,94 |
| Santander Holdings USA, Inc. | | | |
| 4,625 % fällig am 19.04.2016 | 400 | 404 | 1,91 |
| Suncorp-Metway Ltd. | | | |
| 1,303 % fällig am 28.03.2017 | 300 | 300 | 1,42 |
| 1,700 % fällig am 28.03.2017 | 50 | 50 | 0,24 |
| Synchrony Financial | | | |
| 1,564 % fällig am 03.02.2020 | 50 | 49 | 0,23 |
| UBS Group Funding Jersey Ltd. | | | |
| 2,034 % fällig am 24.09.2020 | 300 | 301 | 1,43 |
| | | 8.584 | 40,65 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Actavis Funding SCS | | | |
| 1,289 % fällig am 01.09.2016 | 50 | 50 | 0,24 |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | 250 | 251 | 1,19 |
| BMW US Capital LLC | | | |
| 0,756 % fällig am 02.06.2017 | 200 | 199 | 0,94 |
| Cisco Systems, Inc. | | | |
| 0,914 % fällig am 01.03.2019 | 300 | 300 | 1,42 |
| Continental Airlines 2012-1 Class B Pass-Through Trust | | | |
| 6,250 % fällig am 11.04.2020 | 149 | 157 | 0,74 |
| Daimler Finance N.A. LLC | | | |
| 1,044 % fällig am 03.08.2017 (a) | 350 | 350 | 1,66 |
| eBay, Inc. | | | |
| 0,523 % fällig am 28.07.2017 | 75 | 74 | 0,35 |
| 0,809 % fällig am 01.08.2019 | 145 | 140 | 0,66 |
| General Motors Financial Co., Inc. | | | |
| 1,681 % fällig am 10.04.2018 | 50 | 50 | 0,24 |
| 4,750 % fällig am 15.08.2017 | 300 | 311 | 1,47 |
| Glencore Funding LLC | | | |
| 1,567 % fällig am 27.05.2016 | 50 | 49 | 0,23 |
| 1,700 % fällig am 27.05.2016 | 400 | 398 | 1,89 |
| Imperial Tobacco Finance PLC | | | |
| 2,050 % fällig am 20.07.2018 | $ 250 | $ 249 | 1,18 |
| Lowe's Cos., Inc. | | | |
| 0,907 % fällig am 10.09.2019 | 75 | 75 | 0,35 |
| Marathon Oil Corp. | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | 200 | 204 | 0,97 |
| Medtronic, Inc. | | | |
| 1,312 % fällig am 15.03.2020 | 50 | 50 | 0,24 |
| Mylan, Inc. | | | |
| 1,800 % fällig am 24.06.2016 | 425 | 425 | 2,01 |
| Penske Truck Leasing Co. LP | | | |
| 2,500 % fällig am 15.03.2016 | 50 | 50 | 0,24 |
| Pioneer Natural Resources Co. | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2016 | 50 | 51 | 0,24 |
| QUALCOMM, Inc. | | | |
| 0,920 % fällig am 20.05.2020 (a) | 500 | 490 | 2,32 |
| RCI Banque S.A. | | | |
| 4,600 % fällig am 12.04.2016 | 50 | 51 | 0,24 |
| Reynolds American, Inc. | | | |
| 2,300 % fällig am 12.06.2018 | 200 | 201 | 0,95 |
| 3,500 % fällig am 04.08.2016 | 50 | 51 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2017 | 150 | 160 | 0,76 |
| Sinopec Group Overseas Development 2012 Ltd. | | | |
| 2,750 % fällig am 17.05.2017 | 250 | 252 | 1,20 |
| Sky PLC | | | |
| 6,100 % fällig am 15.02.2018 | 50 | 54 | 0,26 |
| Statoil ASA | | | |
| 0,804 % fällig am 08.11.2018 | 50 | 50 | 0,23 |
| Telefonica Emisiones SAU | | | |
| 3,992 % fällig am 16.02.2016 | 300 | 301 | 1,43 |
| 6,221 % fällig am 03.07.2017 | 50 | 53 | 0,25 |
| Tyson Foods, Inc. | | | |
| 6,600 % fällig am 01.04.2016 | 200 | 203 | 0,96 |
| Union Pacific Corp. | | | |
| 7,000 % fällig am 01.02.2016 | 50 | 50 | 0,24 |
| Viacom, Inc. | | | |
| 6,250 % fällig am 30.04.2016 | 20 | 20 | 0,10 |
| Volkswagen International Finance NV | | | |
| 0,804 % fällig am 18.11.2016 | 400 | 394 | 1,87 |
| Wesfarmers Ltd. | | | |
| 2,983 % fällig am 18.05.2016 | 300 | 302 | 1,43 |
| Woolworths Ltd. | | | |
| 3,150 % fällig am 12.04.2016 | 50 | 50 | 0,24 |
| | | 6.115 | 28,98 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| BG Energy Capital PLC | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2016 | 500 | 505 | 2,39 |
| British Telecommunications PLC | | | |
| 1,625 % fällig am 28.06.2016 | 400 | 401 | 1,90 |
| Chevron Phillips Chemical Co. LLC | | | |
| 1,079 % fällig am 01.05.2020 | 75 | 75 | 0,36 |
| CNOOC Nexen Finance 2014 ULC | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | 300 | 298 | 1,41 |
| Dayton Power & Light Co. | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2016 | 400 | 400 | 1,90 |
| DTE Energy Co. | | | |
| 6,350 % fällig am 01.06.2016 | 75 | 77 | 0,36 |
| El Paso Natural Gas Co. LLC | | | |
| 5,950 % fällig am 15.04.2017 | 200 | 202 | 0,96 |
| Electricite de France S.A. | | | |
| 1,150 % fällig am 20.01.2017 | 300 | 299 | 1,42 |
| Jersey Central Power & Light Co. | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2016 | 30 | 30 | 0,14 |
| Kinder Morgan Energy Partners LP | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2016 | 50 | 50 | 0,24 |
| KT Corp. | | | |
| 1,750 % fällig am 22.04.2017 | 200 | 199 | 0,95 |
| Sprint Communications, Inc. | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | 300 | 300 | 1,42 |
| Verizon Communications, Inc. | | | |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 | 400 | 410 | 1,94 |
| | | 3.246 | 15,39 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | 17.945 | 85,02 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| Fannie Mae | | | |
| 0,722 % fällig am 25.06.2040 | $ 361 | $ 361 | 1,71 |
| Ginnie Mae | | | |
| 0,872 % fällig am 20.11.2065 | 491 | 490 | 2,32 |
| | | 851 | 4,03 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a)(b) | 609 | 602 | 2,85 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| Banc of America Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,415 % fällig am 10.09.2047 | 41 | 42 | 0,20 |
| Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust | | | |
| 5,537 % fällig am 12.10.2041 | 262 | 266 | 1,26 |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,710 % fällig am 10.12.2049 | 400 | 414 | 1,96 |
| Morgan Stanley Capital I Trust | | | |
| 5,328 % fällig am 12.11.2041 | 256 | 258 | 1,23 |
| Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,713 % fällig am 15.06.2049 | 50 | 51 | 0,24 |
| | | 1.031 | 4,89 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| ALM VIII Ltd. | | | |
| 1,967 % fällig am 20.01.2026 | 250 | 251 | 1,19 |
| Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd. | | | |
| 1,658 % fällig am 27.07.2026 | 250 | 252 | 1,19 |
| Ford Credit Auto Owner Trust | | | |
| 0,950 % fällig am 15.08.2018 | 300 | 300 | 1,42 |
| Kingsland III Ltd. | | | |
| 0,597 % fällig am 24.08.2021 | 220 | 218 | 1,03 |
| OHA Credit Partners VI Ltd. | | | |
| 1,582 % fällig am 15.05.2023 | 198 | 197 | 0,94 |
| | | 1.218 | 5,77 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL 2.000 | 472 | 2,23 |
| Korea Development Bank | | | |
| 3,250 % fällig am 09.03.2016 | $ 400 | 402 | 1,90 |
| | | 874 | 4,13 |
| | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (c) | 103 | 10 | 0,05 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 5.983 | 60 | 0,28 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 22.591** | **107,02** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des
## PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 19 | $ (4) | (0,02) |
| CAC 40 10 Euro January Futures | Short | 01/2016 | 16 | 0 | 0,00 |
| FTSE/MIB Index March Futures | Short | 03/2016 | 10 | 2 | 0,01 |
| H-Shares IDX January Futures | Short | 01/2016 | 15 | 10 | 0,05 |
| Nikkei 225 (SGX) March Futures | Short | 03/2016 | 6 | 7 | 0,03 |
| S&P/TSX 60 Index March Futures | Short | 03/2016 | 9 | (5) | (0,02) |
| SPI 200 Index March Futures | Long | 03/2016 | 6 | (4) | (0,02) |
| | | | | $ 6 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 6** | **0,03** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month Canadian Bank Bill | 2,200 % | 16.06.2026 | CAD 1.900 | $ 6 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 % | 19.09.2025 | JPY 1.070.000 | 126 | 0,59 |
| | | | | | $ 132 | 0,62 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 132** | **0,62** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BPS | $ 1,270 | 02.03.2016 | € 6.000 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Canadian dollar | BPS | CAD 1,210 | 23.03.2016 | $ 2.200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 1 | $ 0 | 0,00 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 75 | AUD | 104 | AZD | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 86 | $ | 62 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 800 | NZD | 860 | BOA | 8 | (1) | 7 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 949 | AUD | 1.300 | BOA | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| 01/2016 | AUD | 1.300 | $ | 928 | BRC | 0 | (17) | (17) | (0,08) |
| 01/2016 | | 3.600 | NZD | 3.877 | DUB | 62 | (27) | 35 | 0,17 |
| 01/2016 | NZD | 3.524 | AUD | 3.200 | DUB | 50 | (134) | (84) | (0,40) |
| 01/2016 | AUD | 2.700 | $ | 1.917 | DUB | 0 | (47) | (47) | (0,22) |
| 01/2016 | $ | 1.957 | AUD | 2.700 | HUS | 8 | 0 | 8 | 0,04 |
| 01/2016 | AUD | 3.400 | NZD | 3.614 | MSB | 28 | (28) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | NZD | 4.962 | AUD | 4.600 | MSB | 12 | (62) | (50) | (0,24) |
| 01/2016 | AUD | 18 | $ | 13 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 3.400 | | 856 | BOA | 0 | (3) | (3) | (0,02) |
| 01/2016 | $ | 419 | BRL | 1.600 | BOA | 0 | (15) | (15) | (0,07) |
| 01/2016 | BRL | 2.000 | $ | 504 | MSB | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 973 | BRL | 3.800 | MSB | 0 | (13) | (13) | (0,06) |
| 01/2016 | | 216 | CAD | 300 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 5.062 | $ | 3.814 | BOA | 170 | 0 | 170 | 0,81 |
| 01/2016 | | 8 | | 6 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 152 | CAD | 200 | BRC | 0 | (8) | (8) | (0,04) |
| 01/2016 | | 3.394 | | 4.700 | CBK | 0 | (11) | (11) | (0,05) |
| 01/2016 | | 4.841 | | 6.300 | DUB | 0 | (306) | (306) | (1,45) |
| 01/2016 | CAD | 5.000 | $ | 3.691 | DUB | 91 | 0 | 91 | 0,43 |
| 01/2016 | | 1.438 | | 1.073 | HUS | 38 | 0 | 38 | 0,18 |
| 01/2016 | $ | 6 | CAD | 8 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.125 | CHF | 3.392 | BOA | 150 | (156) | (6) | (0,03) |
| 01/2016 | CHF | 3.409 | € | 3.125 | BOA | 101 | (112) | (11) | (0,05) |
| 01/2016 | € | 2.125 | $ | 2.340 | BOA | 31 | 0 | 31 | 0,15 |
| 01/2016 | $ | 2.326 | € | 2.125 | BOA | 0 | (18) | (18) | (0,08) |
| 01/2016 | JPY | 283.993 | | 2.125 | BOA | 3 | (55) | (52) | (0,25) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 1.500 | £ | 1.059 | BOA | $ 4 | $ (73) | $ (69) | (0,33) |
| 01/2016 | SEK | 18.605 | € | 2.000 | BRC | 0 | (34) | (34) | (0,16) |
| 01/2016 | NOK | 20.278 | | 2.125 | BRC | 93 | (76) | 17 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 146 | | 134 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 155 | $ | 169 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 3.125 | SEK | 28.983 | DUB | 118 | (75) | 43 | 0,20 |
| 01/2016 | NOK | 19.076 | € | 2.000 | DUB | 19 | (1) | 18 | 0,08 |
| 01/2016 | SEK | 10.622 | | 1.125 | DUB | 16 | (54) | (38) | (0,18) |
| 01/2016 | € | 3.250 | NOK | 30.049 | DUB | 119 | (255) | (136) | (0,64) |
| 01/2016 | | 2.750 | £ | 1.985 | DUB | 53 | (115) | (62) | (0,30) |
| 01/2016 | £ | 2.358 | € | 3.250 | DUB | 60 | (4) | 56 | 0,26 |
| 01/2016 | € | 875 | JPY | 115.156 | DUB | 25 | (18) | 7 | 0,03 |
| 01/2016 | | 500 | $ | 535 | DUB | 0 | (8) | (8) | (0,04) |
| 01/2016 | JPY | 153.594 | € | 1.125 | DUB | 3 | (58) | (55) | (0,26) |
| 01/2016 | € | 1.125 | JPY | 149.996 | FBF | 25 | 0 | 25 | 0,12 |
| 01/2016 | | 750 | $ | 795 | HUS | 0 | (19) | (19) | (0,09) |
| 01/2016 | | 9 | | 10 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.125 | JPY | 151.410 | JPM | 41 | (4) | 37 | 0,17 |
| 01/2016 | £ | 1.022 | € | 1.375 | JPM | 36 | (49) | (13) | (0,06) |
| 01/2016 | € | 127 | $ | 138 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 1.000 | £ | 739 | MSB | 14 | (12) | 2 | 0,01 |
| 01/2016 | | 125 | JPY | 16.254 | MSB | 2 | (3) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 875 | NOK | 8.317 | MSB | 7 | (18) | (11) | (0,05) |
| 01/2016 | $ | 107 | € | 98 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 465 | | 625 | MSB | 26 | (32) | (6) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 1.408 | | 1.250 | SOG | 0 | (50) | (50) | (0,24) |
| 01/2016 | | 65 | | 59 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 394.284 | £ | 2.125 | BOA | 5 | (151) | (146) | (0,69) |
| 01/2016 | £ | 1.000 | JPY | 182.817 | BRC | 46 | 0 | 46 | 0,22 |
| 01/2016 | | 2.563 | $ | 3.882 | DUB | 105 | 0 | 105 | 0,50 |
| 01/2016 | JPY | 22.925 | £ | 125 | DUB | 0 | (6) | (6) | (0,03) |
| 01/2016 | £ | 500 | JPY | 90.180 | DUB | 13 | 0 | 13 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 3.886 | £ | 2.563 | DUB | 0 | (109) | (109) | (0,52) |
| 01/2016 | £ | 1.125 | JPY | 203.699 | JPM | 40 | (5) | 35 | 0,17 |
| 01/2016 | | 1.000 | | 185.358 | MSB | 67 | 0 | 67 | 0,32 |
| 01/2016 | JPY | 245.310 | £ | 1.375 | SCX | 9 | (22) | (13) | (0,06) |
| 01/2016 | | 175.000 | $ | 1.456 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 2.259 | JPY | 275.000 | DUB | 27 | 0 | 27 | 0,13 |
| 01/2016 | JPY | 275.000 | $ | 2.234 | MSB | 0 | (52) | (52) | (0,25) |
| 01/2016 | $ | 1.464 | JPY | 175.000 | SOG | 0 | (9) | (9) | (0,04) |
| 01/2016 | MXN | 16.000 | $ | 939 | BOA | 13 | 0 | 13 | 0,06 |
| 01/2016 | | 15.500 | | 921 | BRC | 23 | 0 | 23 | 0,11 |
| 01/2016 | $ | 1.893 | MXN | 31.500 | DUB | 0 | (70) | (70) | (0,33) |
| 01/2016 | MXN | 19.000 | $ | 1.108 | HUS | 8 | 0 | 8 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 1.105 | MXN | 19.000 | SOG | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| 02/2016 | AUD | 104 | $ | 74 | AZD | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| 02/2016 | | 34 | | 24 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 15 | AUD | 21 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 35 | $ | 25 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 6 | CAD | 8 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 34 | $ | 26 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 41 | CHF | 41 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 45 | $ | 48 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | | 32 | | 35 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 12 | £ | 8 | GLM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 112 | | 75 | HUS | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| 02/2016 | | 10 | HKD | 74 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 21 | | 162 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 151 | $ | 19 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 14 | | 2 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 6 | HKD | 45 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | HKD | 301 | $ | 39 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 42 | JPY | 5.146 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 34 | NOK | 295 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 365 | $ | 42 | CBK | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| 04/2016 | NZD | 213 | AUD | 200 | BOA | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 04/2016 | AUD | 2.800 | NZD | 2.975 | MSB | 10 | (13) | (3) | (0,01) |
| 04/2016 | CAD | 4.700 | $ | 3.395 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,05 |
| 04/2016 | € | 1.875 | SEK | 17.230 | DUB | 12 | (4) | 8 | 0,04 |
| 04/2016 | NOK | 8.344 | € | 875 | MSB | 18 | (7) | 11 | 0,05 |
| 04/2016 | £ | 740 | | 1.000 | MSB | 6 | (8) | (2) | (0,01) |
| 04/2016 | | 1.125 | $ | 1.667 | DUB | 8 | 0 | 8 | 0,04 |
| 04/2016 | | 1.375 | JPY | 244.724 | SCX | 13 | 0 | 13 | 0,06 |
| 04/2016 | MXN | 19.000 | $ | 1.098 | SOG | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| 07/2016 | BRL | 2.000 | | 490 | MSB | 15 | 0 | 15 | 0,07 |
| | | | | | | $ 1.872 | $ (2.447) | $ (575) | (2,72) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (575)** | **(2,72)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 22.154** | **104,95** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | **$ (1.045)** | **(4,95)** |
| **Nettovermögen** | **$ 21.109** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.945 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(c) **Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 590 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(e) **Barmittel in Höhe von USD 215 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Barmittel in Höhe von USD 407 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 60 | $ 22.531 | $ 0 | $ 22.591 |
| Finanzderivate[3] | 6 | (443) | 0 | (437) |
| **Summen** | **$ 66** | **$ 22.088** | **$ 0** | **$ 22.154** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

(h) **Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CHF (Hedged) Class und Class E CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 47 | CHF 48 | BOA | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,01 |
| 01/2016 | 2 | 2 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 62 | $ 62 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 58 | CHF 59 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 57 | $ 58 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 58 | CHF 59 | JPM | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| 01/2016 | CHF 49 | $ 49 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 58 | CHF 59 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | CHF 59 | $ 60 | UAG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 59 | CHF 58 | CBK | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | 58 | 57 | JPM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | CHF 1 | $ 1 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 47 | CHF 47 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 60 | 59 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 7 | $ (3) | $ 4 | 0,02 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 4.415 | $ 4.851 | BOA | $ 55 | $ 0 | $ 55 | 0,26 |
| 01/2016 | $ 4.986 | € 4.676 | BOA | 94 | 0 | 94 | 0,45 |
| 01/2016 | € 407 | $ 445 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,02 |
| 01/2016 | 58 | 63 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 760 | 826 | CBK | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 205 | € 190 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | 87 | 81 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| 01/2016 | 4.039 | 3.812 | GLM | 102 | 0 | 102 | 0,48 |
| 01/2016 | € 4.415 | $ 4.851 | HUS | 56 | 0 | 56 | 0,26 |
| 01/2016 | $ 4.911 | € 4.608 | HUS | 95 | 0 | 95 | 0,45 |
| 01/2016 | € 3.734 | $ 4.080 | JPM | 24 | 0 | 24 | 0,11 |
| 01/2016 | 4.623 | 5.050 | UAG | 28 | 0 | 28 | 0,13 |
| 01/2016 | $ 5.298 | € 4.986 | UAG | 119 | 0 | 119 | 0,56 |
| 02/2016 | 4.854 | 4.415 | BOA | 0 | (55) | (55) | (0,26) |
| 02/2016 | 4.855 | 4.415 | HUS | 0 | (56) | (56) | (0,26) |
| 02/2016 | 4.083 | 3.734 | JPM | 0 | (24) | (24) | (0,11) |
| 02/2016 | 4.905 | 4.487 | UAG | 0 | (27) | (27) | (0,13) |
| | | | | $ 581 | $ (164) | $ 417 | 1,97 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 1 | $ 2 | BOA | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 51 | £ 34 | BPS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 3 | $ 5 | BPS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1 | 1 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 63 | £ 42 | CBK | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 40 | $ 59 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 61 | £ 41 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 40 | $ 59 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 40 | 59 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 62 | £ 41 | MSB | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| 01/2016 | £ 34 | $ 50 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 59 | £ 40 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 59 | 40 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 59 | 40 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | 50 | 34 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,02) |

**(i) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 0,700 % | 23.12.2015 | 08.01.2016 | $ 301 | $ (301) | (1,42) |
| RDR | 0,650 % | 20.11.2015 | 20.01.2016 | 952 | (953) | (4,51) |
| RDR | 0,650 % | 03.12.2015 | 20.01.2016 | 331 | (331) | (1,57) |
| SOG | 0,670 % | 02.12.2015 | 02.02.2016 | 778 | (778) | (3,69) |
| SOG | 0,720 % | 04.12.2015 | 14.01.2016 | 491 | (491) | (2,33) |
| | | | | | $ (2.854) | (13,52) |

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (9) | $ 0 | $ (9) |
| BPS | 2 | 0 | 2 |
| BRC | 27 | 0 | 27 |
| CBK | (4) | 0 | (4) |
| DUB | (508) | 590 | 82 |
| FBF | 25 | 0 | 25 |
| GLM | 102 | 0 | 102 |
| HUS | 129 | 0 | 129 |
| JPM | 61 | 0 | 61 |
| MSB | (46) | 0 | (46) |
| SOG | (59) | 0 | (59) |
| UAG | 121 | 0 | 121 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(k) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 107,02 | k. A. |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,03 | k. A. |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,62 | k. A. |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (2,72) | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 933.601 | $ 9.341 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 0,625 % fällig am 30.09.2017 | $ | 2.500 | 2.500 |
| Bank of Nova Scotia | | | |
| 2,150 % fällig am 03.08.2016 | | 1.200 | 1.214 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2018 | | 900 | 900 |
| Province of Ontario Canada | | | |
| 2,300 % fällig am 10.05.2016 | | 800 | 809 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2015 | | 800 | 800 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2015 | | 800 | 800 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 611 | 606 |
| Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | | | |
| 1,087 % fällig am 09.09.2016 | | 600 | 601 |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale | | | |
| 0,875 % fällig am 16.10.2015 | | 600 | 600 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 19.08.2015 | | 600 | 600 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 26.01.2016 | | 600 | 599 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 14.08.2015 | | 545 | 545 |
| Citigroup Commercial Mortgage Trust | | | |
| 5,710 % fällig am 10.12.2049 | | 500 | 527 |
| BG Energy Capital PLC | | | |
| 2,875 % fällig am 15.10.2016 | | 500 | 508 |
| National Bank of Canada | | | |
| 2,200 % fällig am 19.10.2016 | | 500 | 507 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | |
| 2,012 % fällig am 29.11.2023 | | 500 | 505 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | | 500 | 502 |
| DNB Boligkreditt AS | | | |
| 2,100 % fällig am 14.10.2015 | | 500 | 501 |
| Santander Holdings USA, Inc. | | | |
| 3,000 % fällig am 24.09.2015 | | 500 | 500 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 927.678 | $ 9.281 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 0,625 % fällig am 30.09.2017 | $ | 2.500 | 2.500 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2018 | | 900 | 900 |
| Province of Ontario Canada | | | |
| 2,300 % fällig am 10.05.2016 | | 800 | 809 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2015 | | 800 | 800 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2015 | | 800 | 800 |
| Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd. | | | |
| 1,087 % fällig am 09.09.2016 | | 600 | 601 |
| Norddeutsche Landesbank Girozentrale | | | |
| 0,875 % fällig am 16.10.2015 | | 600 | 600 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 26.01.2016 | | 600 | 599 |
| BPCE S.A. | | | |
| 0,934 % fällig am 18.11.2016 | | 400 | 400 |
| General Mills, Inc. | | | |
| 0,624 % fällig am 29.01.2016 | | 400 | 400 |
| Commonwealth Edison Co. | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2016 | | 300 | 310 |
| Hydro-Quebec | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2016 | | 300 | 303 |
| Wm Wrigley Jr Co. | | | |
| 1,400 % fällig am 21.10.2016 | | 300 | 300 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 04.09.2015 | | 300 | 300 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 19.08.2015 | | 300 | 300 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 09.11.2015 | | 300 | 300 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | | 26.905 | 269 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | | | |
| 0,000 % fällig am 18.12.2015 | $ | 250 | 250 |
| Entergy Corp. | | | |
| 0,000 % fällig am 12.01.2016 | | 250 | 250 |

(a) Der PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| APT Pipelines Ltd. | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 | £ | 1.600 | £ 1.480 | 0,59 |
| Scentre Group Trust 1 | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.07.2026 | | 100 | 105 | 0,04 |
| Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 100 | 64 | 0,03 |
| Transurban Finance Co. Pty Ltd. | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.08.2025 | € | 1.300 | 937 | 0,37 |
| | | | 2.586 | 1,03 |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 1.400 | 1.038 | 0,42 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | | 300 | 191 | 0,08 |
| **KANADA** | | | | |
| Glencore Canada Financial Corp. | | | | |
| 7,375 % fällig am 27.05.2020 | £ | 350 | 326 | 0,13 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| Affinity Water Programme Finance Ltd. | | | | |
| 3,625 % fällig am 30.09.2022 | | 350 | 366 | 0,15 |
| Brakes Capital | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.12.2018 | | 800 | 826 | 0,33 |
| IPIC GMTN Ltd. | | | | |
| 6,875 % fällig am 14.03.2026 | | 1.100 | 1.368 | 0,55 |
| Trafford Centre Finance Ltd. | | | | |
| 1,303 % fällig am 28.07.2035 | | 2.400 | 2.181 | 0,87 |
| 4,750 % fällig am 28.04.2024 | | 500 | 528 | 0,21 |
| 7,030 % fällig am 28.01.2029 | | 200 | 245 | 0,10 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 250 | 304 | 0,12 |
| | | | 5.818 | 2,33 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| AP Moeller - Maersk | | | | |
| 4,000 % fällig am 04.04.2025 | | 200 | 203 | 0,08 |
| Danske Bank | | | | |
| 5,375 % fällig am 29.09.2021 | | 200 | 210 | 0,09 |
| TDC | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.02.2023 | | 600 | 651 | 0,26 |
| | | | 1.064 | 0,43 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| AXA S.A. | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.07.2043 | € | 700 | 591 | 0,24 |
| 7,125 % fällig am 15.12.2020 | £ | 1.600 | 1.878 | 0,75 |
| BNP Paribas S.A. | | | | |
| 5,750 % fällig am 24.01.2022 | | 350 | 392 | 0,16 |
| BPCE S.A. | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.12.2022 | € | 600 | 437 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 16.04.2029 | £ | 700 | 735 | 0,29 |
| CNP Assurances | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.09.2041 | | 1.800 | 2.016 | 0,81 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.04.2049 | | 100 | 99 | 0,04 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 300 | 209 | 0,08 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 400 | 300 | 0,12 |
| 8,375 % fällig am 29.10.2049 | | 200 | 153 | 0,06 |
| Electricite de France S.A. | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | £ | 800 | 879 | 0,35 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2049 | $ | 1.700 | 1.088 | 0,44 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | £ | 800 | 912 | 0,36 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.200 | 2.116 | 0,85 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | $ | 300 | 200 | 0,08 |
| Engie S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2060 | £ | 1.200 | 1.466 | 0,59 |
| La Mondiale SAM | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | € | 700 | £ 522 | 0,21 |
| Numericable-SFR SAS | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2022 | | 100 | 76 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | 374 | 0,15 |
| Orange S.A. | | | | |
| 5,250 % fällig am 05.12.2025 | £ | 300 | 349 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 29.10.2049 | | 2.500 | 2.477 | 0,99 |
| 5,875 % fällig am 28.02.2049 | | 200 | 199 | 0,08 |
| SEB S.A. | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | € | 700 | 522 | 0,21 |
| SNCF Reseau | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.12.2021 (b) | £ | 800 | 950 | 0,38 |
| TDF Infrastructure SAS | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | € | 1.200 | 908 | 0,36 |
| Total S.A. | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.12.2049 | | 2.500 | 1.633 | 0,65 |
| Wendel S.A. | | | | |
| 2,500 % fällig am 09.02.2027 | | 100 | 70 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 02.10.2024 | | 1.200 | 896 | 0,36 |
| | | | 22.447 | 8,98 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| Deutsche Wohnen AG | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.07.2020 | | 900 | 669 | 0,27 |
| KFW | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 (b) | £ | 300 | 426 | 0,17 |
| Merck KGaA | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.12.2074 | € | 800 | 583 | 0,23 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.05.2042 | | 700 | 628 | 0,25 |
| 6,625 % fällig am 26.05.2042 | £ | 300 | 340 | 0,14 |
| Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2023 | € | 81 | 64 | 0,02 |
| | | | 2.710 | 1,08 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| Credit Suisse Group Guernsey I Ltd. | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | $ | 300 | 210 | 0,08 |
| **IRLAND** | | | | |
| AerCap Ireland Capital Ltd. | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 800 | 553 | 0,22 |
| GE Capital UK Funding | | | | |
| 5,125 % fällig am 24.05.2023 | £ | 500 | 577 | 0,23 |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 1.400 | 1.855 | 0,74 |
| 8,000 % fällig am 14.01.2039 | | 200 | 333 | 0,14 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 76.000 | 7.671 | 3,07 |
| | | | 10.989 | 4,40 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| Atlantia SpA | | | | |
| 6,250 % fällig am 09.06.2022 | £ | 158 | 189 | 0,07 |
| Banco Popolare SC | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.07.2020 | € | 500 | 369 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | | 600 | 454 | 0,18 |
| Berica ABS Srl | | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | | 355 | 259 | 0,10 |
| Davide Campari-Milano SpA | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | | 1.500 | 1.134 | 0,45 |
| Indesit Co. SpA | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.04.2018 | | 900 | 715 | 0,29 |
| Societa Esercizi Aereoportuali SpA Sea | | | | |
| 3,125 % fällig am 17.04.2021 | | 1.700 | 1.270 | 0,51 |
| TeamSystem Holding SpA | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | | 200 | 153 | 0,06 |
| Telecom Italia SpA | | | | |
| 5,875 % fällig am 19.05.2023 | £ | 900 | 970 | 0,39 |
| UniCredit SpA | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | £ 139 | 0,06 |
| | | | 5.652 | 2,26 |
| **JAPAN** | | | | |
| Mitsubishi Corp. | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.07.2024 | $ | 600 | 405 | 0,16 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| AA Bond Co. Ltd. | | | | |
| 3,781 % fällig am 31.07.2019 | £ | 1.650 | 1.671 | 0,67 |
| 4,720 % fällig am 31.07.2018 | | 1.000 | 1.040 | 0,42 |
| Atrium European Real Estate Ltd. | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | € | 2.200 | 1.726 | 0,69 |
| CPUK Finance Ltd. | | | | |
| 3,588 % fällig am 28.08.2025 | £ | 500 | 486 | 0,19 |
| Gatwick Funding Ltd. | | | | |
| 4,625 % fällig am 27.03.2034 | | 450 | 488 | 0,20 |
| Heathrow Funding Ltd. | | | | |
| 7,125 % fällig am 14.02.2024 | | 250 | 307 | 0,12 |
| HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP | | | | |
| 5,844 % fällig am 29.11.2049 | | 1.450 | 1.584 | 0,63 |
| Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | | 1.300 | 1.272 | 0,51 |
| | | | 8.574 | 3,43 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.03.2035 | $ | 100 | 66 | 0,03 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 600 | 577 | 0,23 |
| Glencore Finance Europe S.A. | | | | |
| 4,625 % fällig am 03.04.2018 | € | 500 | 346 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2017 | | 300 | 218 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 27.02.2019 | £ | 400 | 373 | 0,15 |
| Greif Nevada Holdings, Inc. SCS | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.07.2021 | € | 400 | 343 | 0,14 |
| Prologis International Funding II S.A. | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | | 500 | 343 | 0,14 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 4,950 % fällig am 07.02.2017 | $ | 200 | 137 | 0,05 |
| Wind Acquisition Finance S.A. | | | | |
| 7,000 % fällig am 23.04.2021 | € | 500 | 366 | 0,14 |
| | | | 2.769 | 1,11 |
| **MEXIKO** | | | | |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 8,250 % fällig am 02.06.2022 | £ | 213 | 252 | 0,10 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.01.2019 | | 700 | 761 | 0,30 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 2.500 | 2.197 | 0,88 |
| 6,910 % fällig am 29.06.2049 | £ | 189 | 228 | 0,09 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 1.100 | 770 | 0,31 |
| Demeter Investments BV for Swiss Re Ltd. | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2050 | | 600 | 407 | 0,16 |
| Deutsche Telekom International Finance BV | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.04.2022 | £ | 250 | 304 | 0,12 |
| E.ON International Finance BV | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 1.000 | 1.146 | 0,46 |
| 6,375 % fällig am 07.06.2032 | | 100 | 120 | 0,05 |
| Enel Finance International NV | | | | |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | | 1.500 | 1.782 | 0,71 |
| JAB Holdings BV | | | | |
| 2,125 % fällig am 16.09.2022 | € | 500 | 369 | 0,15 |
| Koninklijke KPN NV | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.11.2026 | £ | 400 | 435 | 0,17 |
| Madrilena Red de Gas Finance BV | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | € | 100 | 87 | 0,04 |
| NN Group NV | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | | 400 | 291 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 08.04.2044 | | 600 | 461 | 0,18 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.05.2022 | € | 100 | £ 76 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2023 | $ | 1.000 | 668 | 0,27 |
| **Siemens Financieringsmaatschappij NV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 10.09.2025 | £ | 900 | 894 | 0,36 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 22.07.2019 | € | 1.200 | 895 | 0,36 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.12.2023 | | 2.600 | 1.907 | 0,76 |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 900 | 617 | 0,25 |
| | | | 14.415 | 5,77 |
| **KATAR** | | | | |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III** | | | | |
| 5,832 % fällig am 30.09.2016 | | 7 | 5 | 0,00 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **Temasek Financial I Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | £ | 1.220 | 1.585 | 0,63 |
| **SLOWAKEI** | | | | |
| **SPP-Distribucia** | | | | |
| 2,625 % fällig am 23.06.2021 | € | 1.000 | 768 | 0,31 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.04.2020 | | 1.200 | 831 | 0,33 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 29.05.2049 | $ | 200 | 146 | 0,06 |
| **Iberdrola Finanzas SAU** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.07.2022 | £ | 800 | 950 | 0,38 |
| **IE2 Holdco SAU** | | | | |
| 2,375 % fällig am 27.11.2023 | € | 2.000 | 1.449 | 0,58 |
| **Inmobiliaria Colonial S.A.** | | | | |
| 2,728 % fällig am 05.06.2023 | | 800 | 585 | 0,23 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 5,597 % fällig am 12.03.2020 | £ | 3.000 | 3.312 | 1,33 |
| | | | 7.273 | 2,91 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.12.2027 | | 350 | 395 | 0,16 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 200 | 278 | 0,11 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 700 | 961 | 0,38 |
| **International Bank for Reconstruction & Development** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | | 700 | 1.002 | 0,40 |
| | | | 2.636 | 1,05 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 | € | 1.500 | 1.207 | 0,48 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.300 | 930 | 0,37 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2023 | | 800 | 553 | 0,22 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 2.500 | 1.717 | 0,69 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 2.500 | 1.775 | 0,71 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 650 | 503 | 0,20 |
| | | | 6.685 | 2,67 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abbey National Treasury Services PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2029 | £ | 400 | 423 | 0,17 |
| **ABP Finance PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 250 | 306 | 0,12 |
| **Annington Finance No.4 PLC** | | | | |
| 1,746 % fällig am 10.01.2023 | | 100 | 100 | 0,04 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | |
| 5,340 % fällig am 30.06.2030 | | 1.600 | 1.739 | 0,70 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 16.08.2019 | | 1.400 | 1.572 | 0,63 |
| 7,281 % fällig am 29.05.2049 | | 100 | 118 | 0,05 |
| 9,375 % fällig am 15.05.2021 | | 90 | 115 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 1.800 | £ 1.393 | 0,56 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 1.935 | 2.500 | 1,00 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 1.000 | 1.295 | 0,52 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 1.150 | 1.152 | 0,46 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 12.03.2024 | | 700 | 897 | 0,36 |
| **BBC Pacific Quay Finance PLC** | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 191 | 226 | 0,09 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | $ | 3.100 | 2.906 | 1,17 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | £ | 100 | 113 | 0,05 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.12.2028 | | 700 | 848 | 0,34 |
| **BUPA Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.06.2021 | | 600 | 616 | 0,25 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 2.150 | 2.347 | 0,94 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | | 1.070 | 1.174 | 0,47 |
| **Debenhams PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2021 | | 1.500 | 1.500 | 0,60 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 06.10.2023 | | 2.900 | 2.907 | 1,16 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,528 % fällig am 09.11.2020 | € | 1.800 | 1.339 | 0,54 |
| 2,759 % fällig am 13.11.2019 | £ | 100 | 101 | 0,04 |
| **GKN Holdings PLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 19.09.2022 | | 100 | 110 | 0,04 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 2.450 | 3.011 | 1,20 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 2,663 % fällig am 15.03.2036 | | 900 | 780 | 0,31 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 100 | 111 | 0,04 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 1.813 | 2.048 | 0,82 |
| 5,702 % fällig am 15.12.2034 | | 150 | 140 | 0,06 |
| **Gwynt y Mor OFTO PLC** | | | | |
| 2,778 % fällig am 17.02.2034 | | 876 | 834 | 0,33 |
| **Hammerson PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 23.02.2026 | | 900 | 1.088 | 0,44 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | |
| 4,009 % fällig am 15.10.2054 | | 600 | 625 | 0,25 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2025 | € | 700 | 525 | 0,21 |
| 5,100 % fällig am 05.04.2021 | $ | 650 | 491 | 0,20 |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.300 | 947 | 0,38 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | £ | 500 | 589 | 0,24 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 600 | 446 | 0,18 |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 400 | 272 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 20.05.2024 | £ | 1.000 | 1.235 | 0,49 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 28.09.2026 | | 2.100 | 2.454 | 0,98 |
| 7,750 % fällig am 24.06.2019 | | 300 | 354 | 0,14 |
| 9,000 % fällig am 17.02.2022 | | 500 | 663 | 0,26 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 700 | 698 | 0,28 |
| 3,875 % fällig am 28.11.2022 | | 1.500 | 1.540 | 0,62 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 850 | 1.012 | 0,40 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 400 | 544 | 0,22 |
| **LCR Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 1.400 | 1.760 | 0,70 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 1.900 | 1.807 | 0,72 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | | 2.100 | 2.499 | 1,00 |
| 7,625 % fällig am 22.04.2025 | | 700 | 898 | 0,36 |
| 10,375 % fällig am 12.02.2024 | € | 1.890 | 1.756 | 0,70 |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.442 | 1.396 | 0,56 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 500 | 525 | 0,21 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 31.03.2023 | | 1.300 | 1.482 | 0,59 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 02.04.2024 | £ | 1.000 | £ 1.065 | 0,43 |
| 4,750 % fällig am 31.03.2034 | | 800 | 884 | 0,35 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,033 % fällig am 15.12.2030 | | 159 | 143 | 0,06 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 29.11.2030 | | 200 | 255 | 0,10 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 08.06.2027 | | 100 | 109 | 0,04 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.09.2021 | | 800 | 908 | 0,36 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 5,625 % fällig am 09.09.2019 | | 800 | 903 | 0,36 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 2.100 | 2.707 | 1,08 |
| **New Look Secured Issuer PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.07.2022 | | 700 | 697 | 0,28 |
| **NGG Finance PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 18.06.2073 | | 2.000 | 2.068 | 0,83 |
| **Northern Gas Networks Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.06.2027 | | 100 | 114 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 23.03.2040 | | 150 | 187 | 0,07 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 18.06.2026 | | 800 | 785 | 0,31 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 600 | 425 | 0,17 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 6,934 % fällig am 09.04.2018 | € | 600 | 496 | 0,20 |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 1.400 | 1.030 | 0,41 |
| 10,500 % fällig am 16.03.2022 | € | 400 | 329 | 0,13 |
| 13,125 % fällig am 19.03.2022 | AUD | 200 | 109 | 0,04 |
| **RSA Insurance Group PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 10.10.2045 | £ | 1.200 | 1.166 | 0,47 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 16.01.2026 | | 800 | 827 | 0,33 |
| 6,125 % fällig am 26.02.2024 | | 796 | 967 | 0,39 |
| 6,250 % fällig am 07.06.2029 | | 200 | 260 | 0,10 |
| **Sky PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.11.2020 | | 150 | 152 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 26.11.2029 | | 200 | 202 | 0,08 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 800 | 828 | 0,33 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.11.2031 | | 150 | 199 | 0,08 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 03.02.2025 | | 300 | 286 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 21.12.2020 | | 550 | 616 | 0,25 |
| 4,875 % fällig am 05.10.2023 | | 1.000 | 1.127 | 0,45 |
| **SP Manweb PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 20.09.2027 | | 100 | 114 | 0,05 |
| **SPD Finance UK PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 17.07.2026 | | 600 | 734 | 0,29 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 1,139 % fällig am 28.12.2021 | | 80 | 74 | 0,03 |
| 1,139 % fällig am 28.12.2028 | | 152 | 121 | 0,05 |
| 2,389 % fällig am 28.12.2036 | | 100 | 94 | 0,04 |
| 5,472 % fällig am 28.12.2028 | | 2.272 | 2.306 | 0,92 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 1.350 | 1.414 | 0,57 |
| **Standard Chartered Bank** | | | | |
| 8,103 % fällig am 29.05.2049 | | 2.371 | 2.410 | 0,96 |
| **Stonegate Pub Co. Financing PLC** | | | | |
| 5,329 % fällig am 15.04.2019 | | 100 | 100 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2019 | | 100 | 102 | 0,04 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2031 | | 1.255 | 1.225 | 0,49 |
| **Telereal Securitisation PLC** | | | | |
| 4,090 % fällig am 10.12.2033 | | 1.300 | 1.311 | 0,52 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 4.136 | 3.899 | 1,56 |
| **Tesco Property Finance 6 PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 99 | 85 | 0,03 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | | 1.300 | 1.316 | 0,53 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 1.347 | 1.409 | 0,56 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 700 | £ 644 | 0,26 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | | 200 | 213 | 0,09 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.07.2049 | | 1.300 | 1.311 | 0,52 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | | 700 | 686 | 0,27 |
| **Wellcome Trust Ltd.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 21.01.2027 | € | 1.800 | 1.265 | 0,51 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | £ | 275 | 371 | 0,15 |
| **Western Power Distribution PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 06.11.2023 | | 300 | 300 | 0,12 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 650 | 823 | 0,33 |
| **Western Power Distribution West Midlands PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 17.10.2024 | | 1.050 | 1.107 | 0,44 |
| 5,750 % fällig am 16.04.2032 | | 1.100 | 1.365 | 0,55 |
| 6,000 % fällig am 09.05.2025 | | 250 | 306 | 0,12 |
| **Whitbread Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.10.2025 | | 500 | 496 | 0,20 |
| **WM Morrison Supermarkets PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.07.2026 | | 300 | 271 | 0,11 |
| | | | 104.146 | 41,66 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Business Mortgage Finance 5 PLC** | | | | |
| 0,953 % fällig am 15.02.2039 | | 90 | 88 | 0,03 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | | 451 | 444 | 0,18 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | | 305 | 294 | 0,12 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.781 | 1.217 | 0,49 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 271 | 243 | 0,10 |
| **Residential Mortgage Securities 25 PLC** | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | | 419 | 428 | 0,17 |
| **Tenterden Funding PLC** | | | | |
| 2,085 % fällig am 21.03.2044 | | 158 | 160 | 0,06 |
| | | | 2.874 | 1,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 (b)(c)(d) | | 500 | 504 | 0,20 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (b) | | 4.000 | 4.459 | 1,79 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 (b)(d) | | 1.800 | 2.102 | 0,84 |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 (c)(d) | | 4.000 | 4.100 | 1,64 |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 (b) | | 3.700 | 4.679 | 1,87 |
| | | | 15.844 | 6,34 |
| Summe Großbritannien | | | 122.864 | 49,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,136 % fällig am 15.12.2039 | £ | 1.163 | £ 973 | 0,39 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | $ | 200 | 136 | 0,05 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.04.2023 | £ | 1.200 | 1.340 | 0,54 |
| 5,750 % fällig am 15.03.2067 | | 800 | 820 | 0,33 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.09.2029 | | 500 | 509 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 07.12.2026 | | 1.350 | 1.577 | 0,63 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | $ | 600 | 392 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 15.03.2027 | £ | 300 | 348 | 0,14 |
| **BAE Systems Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.12.2025 | $ | 500 | 336 | 0,13 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.09.2021 | £ | 1.700 | 1.991 | 0,80 |
| 7,000 % fällig am 31.07.2028 | | 450 | 607 | 0,24 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2020 | $ | 293 | 72 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 785 | 282 | 0,11 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.09.2039 | £ | 350 | 523 | 0,21 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2021 | $ | 1.000 | 630 | 0,25 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 17.01.2025 | £ | 200 | 204 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 13.10.2023 | | 500 | 528 | 0,21 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 18.09.2037 | | 1.200 | 1.384 | 0,55 |
| 5,375 % fällig am 18.12.2040 | | 1.300 | 1.692 | 0,68 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.01.2020 | $ | 2.100 | 1.413 | 0,57 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 14.05.2017 | £ | 1.300 | 1.374 | 0,55 |
| 7,250 % fällig am 10.04.2028 | | 600 | 815 | 0,33 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 6,676 % fällig am 15.01.2021 | $ | 3.000 | 2.339 | 0,94 |
| **International Business Machines Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.08.2022 | £ | 200 | 202 | 0,08 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 16.03.2022 | € | 800 | 480 | 0,19 |
| 4,300 % fällig am 01.06.2025 | $ | 300 | 176 | 0,07 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 1.600 | 1.636 | 0,65 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | £ | 800 | £ 798 | 0,32 |
| 2,875 % fällig am 11.01.2023 | | 200 | 202 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 30.09.2026 | | 1.800 | 1.883 | 0,75 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.12.2035 | | 1.100 | 1.111 | 0,44 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 03.06.2038 | | 900 | 1.246 | 0,50 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 1,375 % fällig am 13.05.2021 | € | 1.000 | 726 | 0,29 |
| 3,375 % fällig am 20.02.2024 | | 1.000 | 796 | 0,32 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2020 | | 200 | 149 | 0,06 |
| 2,150 % fällig am 21.07.2022 | | 600 | 457 | 0,18 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | £ | 300 | 267 | 0,11 |
| **Time Warner, Inc.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.09.2023 | € | 400 | 300 | 0,12 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | | 1.300 | 951 | 0,38 |
| 3,500 % fällig am 12.09.2029 | £ | 900 | 917 | 0,37 |
| 4,875 % fällig am 29.11.2035 | | 700 | 769 | 0,31 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2023 | € | 1.900 | 1.337 | 0,54 |
| | | | 33.715 | 13,49 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 1,457 % fällig am 25.11.2042 | $ | 52 | 33 | 0,01 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 1,443 % fällig am 01.07.2044 | | 26 | 18 | 0,01 |
| 2,351 % fällig am 01.08.2036 | | 60 | 43 | 0,02 |
| **Fannie Mae TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | | 4.000 | 2.714 | 1,08 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | | 5.000 | 3.493 | 1,40 |
| | | | 6.268 | 2,51 |
| Summe USA | | | 40.989 | 16,40 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 40.132 | 272 | 0,11 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **£ 262.523** | **105,02** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 179 | £ 1 | 0,00 |
| Euro-BTP 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 27 | (29) | (0,01) |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 253 | (153) | (0,06) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 29 | 12 | 0,00 |
| | | | | £ (169) | (0,07) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ (169)** | **(0,07)** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 8.100 | £ (10) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 13.000 | 61 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 10.200 | 24 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 43.100 | (108) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 5.300 | (22) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 10.700 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 100 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 2.400 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 11.300 | (65) | (0,03) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 300 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.09.2045 | 6.200 | 318 | 0,13 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 2.000 | (67) | (0,03) |
| | | | | | £ 121 | 0,05 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ 121** | **0,05** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Abertis Infraestructuras S.A. | 1,000 % | 20.03.2020 | JPM | € 1.300 | £ 3 | £ 0 | £ 3 | 0,00 |
| Bank of America Corp. | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | $ 3.400 | 31 | 24 | 7 | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | BRC | 500 | (1) | (9) | 8 | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | SOG | € 900 | 0 | 3 | (3) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | CBK | 1.800 | (12) | 4 | (16) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | 1.900 | (13) | 7 | (20) | (0,01) |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | JPM | 1.000 | (7) | 3 | (10) | 0,00 |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. | 5,000 % | 20.06.2021 | FBF | 700 | 91 | 108 | (17) | 0,04 |
| Pearson PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 800 | 3 | 4 | (1) | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | $ 8.400 | 37 | (14) | 51 | 0,01 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 400 | (25) | (20) | (5) | (0,01) |
| RWE Finance II BV | 1,000 % | 20.03.2022 | BRC | € 2.700 | (51) | 0 | (51) | (0,02) |
| Shell International Finance BV | 1,000 % | 20.03.2021 | BRC | 1.000 | 2 | 13 | (11) | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 2.500 | (2) | (11) | 9 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 900 | (16) | (45) | 29 | (0,01) |
| Wendel S.A. | 5,000 % | 20.06.2021 | BRC | 100 | 15 | 15 | 0 | 0,01 |
| | | | | | £ 55 | £ 82 | £ (27) | 0,02 |

[1] Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,535 % | 15.05.2045 | MYC | £ 250 | £ 13 | £ 0 | £ 13 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,537 % | 15.05.2045 | BOA | 100 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,543 % | 15.05.2045 | GLM | 100 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | £ 24 | £ 0 | £ 24 | 0,01 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CNH | 11.410 | $ | 1.732 | SOG | £ 30 | £ (28) | £ 2 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 881.498 | | 749 | BRC | 5 | (5) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 3.219 | | 749 | JPM | 5 | (3) | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 3.129 | £ | 1.503 | JPM | 0 | (39) | (39) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 162 | € | 223 | BOA | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 1.125 | £ | 790 | BOA | 0 | (40) | (40) | (0,02) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | € | 58.451 | £ | 41.513 | CBK | £ 0 | £ (1.604) | £ (1.604) | (0,64) |
| 02/2016 | £ | 1.885 | € | 2.586 | CBK | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 2.488 | £ | 1.799 | HUS | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 181 | € | 250 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | | 147 | | 208 | MSB | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 562 | | 517 | SCX | 5 | (5) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 1.228 | | 1.702 | SCX | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 2.019 | £ | 1.420 | SOG | 0 | (69) | (69) | (0,03) |
| 02/2016 | £ | 299 | $ | 451 | BOA | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.303 | £ | 863 | CBK | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| 02/2016 | | 31.855 | | 21.090 | HUS | 0 | (521) | (521) | (0,21) |
| 02/2016 | £ | 1.054 | $ | 1.588 | HUS | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 442 | £ | 289 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 239.700 | | 1.295 | JPM | 0 | (58) | (58) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 1.835 | | 1.210 | MSB | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 1.011 | $ | 1.509 | MSB | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.986 | JPY | 238.676 | MSB | 40 | (40) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1.060 | $ | 749 | JPM | 5 | (3) | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 27.181 | | 749 | MSB | 5 | (9) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 24.685 | | 749 | GLM | 5 | (4) | 1 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 14.305 | | 2.211 | SCX | 66 | (1) | 65 | 0,03 |
| | | | | | | £ 271 | £ (2.532) | £ (2.261) | (0,90) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (2.182)** | **(0,87)** |
| **Summe Anlagen** | **£ 260.293** | **104,13** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 11 | £ 7 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 166 | 82 | 0,03 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 58 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 299 | 203 | 0,08 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 2 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 93 | 63 | 0,03 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 90 | 61 | 0,03 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 97 | 48 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 522 | 385 | 0,15 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 25 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **£ 855** | **0,34** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **£ (11.176)** | **(4,47)** |
| **Nettovermögen** | | | **£ 249.972** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

**(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 14.452 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 173 und Barmittel in Höhe von GPB 928 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.771 und Barmittel in Höhe von GBP 320 als Sicherheiten für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(e) Barmittel in Höhe von GBP 886 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 7.943 | £ 254.580 | £ 0 | £ 262.523 |
| Finanzderivate[3] | (169) | (2.061) | 0 | (2.230) |
| **Summen** | **£ 7.774** | **£ 252.519** | **£ 0** | **£ 260.293** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 9.742 | £ 301.982 | £ 0 | £ 311.724 |
| Finanzderivate[3] | 218 | 2.741 | 0 | 2.959 |
| **Summen** | **£ 9.960** | **£ 304.723** | **£ 0** | **£ 314.683** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 0,770 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | £ 4.841 | £ (4.846) | (1,94) |
| SCX | 0,770 % | 10.12.2015 | 11.02.2016 | 6.455 | (6.458) | (2,58) |
| | | | | | £ (11.304) | (4,52) |

**(h) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 0,749 % | 15.10.2015 | 12.01.2016 | £ 441 | £ (442) | (0,18) |
| BRC | 0,755 % | 15.10.2015 | 12.01.2016 | 360 | (361) | (0,14) |
| BRC | 0,771 % | 11.12.2015 | 11.02.2016 | 1.796 | (1.802) | (0,72) |
| MBC | 0,849 % | 07.12.2015 | 12.01.2016 | 596 | (597) | (0,24) |
| | | | | | £ (3.202) | (1,28) |

(1) In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind GBP 5 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ (28) | £ 0 | £ (28) |
| BRC | (35) | 30 | (5) |
| CBK | (1.584) | 1.757 | 173 |
| FBF | 91 | 0 | 91 |
| GLM | 7 | 0 | 7 |
| GST | (38) | 0 | (38) |
| HUS | (497) | 304 | (193) |
| JPM | (118) | 0 | (118) |
| MSB | (19) | 0 | (19) |
| MYC | 13 | 0 | 13 |
| SCX | 93 | 0 | 93 |
| SOG | (67) | 0 | (67) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 105,02 | 99,16 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,07) | 0,07 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,05 | 0,14 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,87) | 0,73 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## UK Corporate Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 30.600 | £ 27.091 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 21.500 | 24.749 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 7.400 | 10.078 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | | 9.620 | 9.904 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 80.000 | 8.068 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2015 | £ | 6.400 | 6.384 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 2.400 | 3.034 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 18.09.2037 | | 2.186 | 2.616 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 2.300 | 2.315 |
| **NGG Finance PLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 18.06.2073 | | 2.000 | 2.180 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 1.800 | 2.160 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.12.2015 | | 2.100 | 2.094 |
| **GE Capital UK Funding** | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 1.400 | 1.896 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.02.2016 | | 1.900 | 1.895 |
| **Vonovia Finance BV** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.12.2023 | € | 2.600 | 1.861 |
| **Enel Finance International NV** | | | |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | £ | 1.500 | 1.849 |
| **Total S.A.** | | | |
| 2,625 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.500 | 1.844 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | |
| 5,375 % fällig am 18.12.2040 | £ | 1.300 | 1.755 |
| **FCE Bank PLC** | | | |
| 1,528 % fällig am 09.11.2020 | € | 2.300 | 1.645 |
| **Engie S.A.** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2060 | £ | 1.200 | 1.621 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 28.700 | £ 32.135 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 30.600 | 25.765 |
| **LCR Finance PLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | £ | 7.808 | 10.332 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 7.400 | 10.114 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 98.000 | 9.887 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2015 | £ | 6.400 | 6.385 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | | 5.620 | 5.794 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 20.12.2027 | | 3.900 | 4.019 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | | 3.700 | 3.743 |
| **AB Acquisitions** | | | |
| 3,985 % fällig am 10.07.2017 | | 3.500 | 3.500 |
| **RWE Finance BV** | | | |
| 5,500 % fällig am 06.07.2022 | | 2.750 | 3.280 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 5,000 % fällig am 07.03.2025 | | 2.500 | 3.257 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 2.400 | 2.416 |
| **GE Capital International Funding Co.** | | | |
| 1,363 % fällig am 15.04.2016 | | 2.407 | 2.412 |
| **Telecom Italia SpA** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2017 | | 1.900 | 2.124 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.12.2015 | | 2.100 | 2.094 |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 1.550 | 2.087 |
| **Electricite de France S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.000 | 2.073 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 1.500 | 2.015 |
| **SSE PLC** | | | |
| 5,453 % fällig am 29.09.2049 | | 1.900 | 1.939 |

(a) Der UK Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Long Term Corporate Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| APT Pipelines Ltd. | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 | £ | 3.381 | £ 3.127 | 0,55 |
| Scentre Group Trust 1 | | | | |
| 3,875 % fällig am 16.07.2026 | | 1.700 | 1.784 | 0,31 |
| Sydney Airport Finance Co. Pty Ltd. | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 100 | 64 | 0,01 |
| | | | 4.975 | 0,87 |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 1.800 | 1.334 | 0,23 |
| Solvay S.A. | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.12.2027 | € | 1.200 | 894 | 0,16 |
| | | | 2.228 | 0,39 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| Hiscox Ltd. | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.11.2045 | £ | 1.600 | 1.613 | 0,28 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | $ | 900 | 572 | 0,10 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| IPIC GMTN Ltd. | | | | |
| 6,875 % fällig am 14.03.2026 | £ | 1.650 | 2.052 | 0,36 |
| Thames Water Utilities Cayman Finance Ltd. | | | | |
| 5,500 % fällig am 11.02.2041 | | 1.600 | 1.988 | 0,35 |
| Trafford Centre Finance Ltd. | | | | |
| 1,303 % fällig am 28.07.2035 | | 1.450 | 1.318 | 0,23 |
| 6,500 % fällig am 28.07.2033 | | 629 | 810 | 0,14 |
| 7,030 % fällig am 28.01.2029 | | 1.797 | 2.206 | 0,38 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 400 | 486 | 0,08 |
| Wynn Macau Ltd. | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | $ | 550 | 330 | 0,06 |
| | | | 9.190 | 1,60 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| AP Moeller - Maersk | | | | |
| 4,000 % fällig am 04.04.2025 | £ | 1.325 | 1.345 | 0,23 |
| DONG Energy | | | | |
| 4,875 % fällig am 12.01.2032 | | 1.650 | 1.813 | 0,32 |
| | | | 3.158 | 0,55 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| AXA S.A. | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.07.2043 | € | 3.200 | 2.704 | 0,47 |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | £ | 2.300 | 2.310 | 0,40 |
| BPCE S.A. | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.04.2029 | | 2.900 | 3.045 | 0,53 |
| CNP Assurances | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.09.2041 | | 3.700 | 4.144 | 0,72 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 700 | 487 | 0,09 |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 800 | 600 | 0,11 |
| Electricite de France S.A. | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | £ | 300 | 330 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 29.01.2049 | $ | 300 | 192 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | £ | 500 | 570 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 17.10.2041 | | 4.000 | 4.539 | 0,79 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 8.000 | 7.694 | 1,34 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | $ | 5.800 | 3.866 | 0,68 |
| 6,000 % fällig am 23.01.2114 | £ | 1.200 | 1.487 | 0,26 |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 | | 3.800 | 4.632 | 0,81 |
| Engie S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2060 | | 900 | 1.100 | 0,19 |
| La Mondiale SAM | | | | |
| 5,050 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.100 | 820 | 0,14 |
| Numericable-SFR SAS | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 800 | 599 | 0,11 |
| Orange S.A. | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.01.2034 | £ | 1.500 | £ 1.786 | 0,31 |
| 5,750 % fällig am 29.10.2049 | | 600 | 594 | 0,11 |
| SNCF Reseau | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.03.2052 | | 600 | 801 | 0,14 |
| Solvay Finance S.A. | | | | |
| 5,869 % fällig am 29.12.2049 | € | 1.500 | 1.103 | 0,19 |
| Suez Environnement Co. | | | | |
| 5,375 % fällig am 02.12.2030 | £ | 800 | 959 | 0,17 |
| Total S.A. | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.900 | 1.894 | 0,33 |
| | | | 46.256 | 8,08 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| KFW | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | £ | 500 | 710 | 0,12 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | | | | |
| 6,250 % fällig am 26.05.2042 | € | 1.200 | 1.077 | 0,19 |
| 6,625 % fällig am 26.05.2042 | £ | 1.000 | 1.134 | 0,20 |
| | | | 2.921 | 0,51 |
| **GUERNSEY** | | | | |
| Credit Suisse Group Guernsey I Ltd. | | | | |
| 7,875 % fällig am 24.02.2041 | $ | 300 | 210 | 0,04 |
| States of Guernsey | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.12.2046 | £ | 3.000 | 2.934 | 0,51 |
| | | | 3.144 | 0,55 |
| **IRLAND** | | | | |
| GE Capital UK Funding | | | | |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 900 | 1.193 | 0,21 |
| 6,250 % fällig am 05.05.2038 | | 5.518 | 7.788 | 1,36 |
| 8,000 % fällig am 14.01.2039 | | 1.750 | 2.914 | 0,51 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 216.700 | 21.871 | 3,82 |
| | | | 33.766 | 5,90 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| Banco Popolare SC | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.07.2020 | € | 1.300 | 959 | 0,17 |
| Enel SpA | | | | |
| 5,750 % fällig am 22.06.2037 | £ | 500 | 594 | 0,10 |
| Finmeccanica SpA | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | | 900 | 1.052 | 0,18 |
| Intesa Sanpaolo Vita SpA | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.100 | 1.546 | 0,27 |
| Republik Italien | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 100 | 121 | 0,02 |
| TeamSystem Holding SpA | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | € | 400 | 307 | 0,05 |
| Telecom Italia SpA | | | | |
| 5,875 % fällig am 19.05.2023 | £ | 2.000 | 2.157 | 0,38 |
| UniCredit SpA | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 (b) | € | 400 | 278 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 03.04.2049 | $ | 600 | 386 | 0,07 |
| | | | 7.400 | 1,29 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| AA Bond Co. Ltd. | | | | |
| 3,781 % fällig am 31.07.2019 | £ | 200 | 203 | 0,04 |
| 6,269 % fällig am 31.07.2025 | | 500 | 583 | 0,10 |
| ASIF III Jersey Ltd. | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.12.2018 | | 50 | 54 | 0,01 |
| Gatwick Funding Ltd. | | | | |
| 4,625 % fällig am 27.03.2034 | | 1.000 | 1.083 | 0,19 |
| 5,750 % fällig am 23.01.2037 | | 350 | 431 | 0,07 |
| Heathrow Funding Ltd. | | | | |
| 6,450 % fällig am 10.12.2031 | | 2.240 | 2.981 | 0,52 |
| 7,125 % fällig am 14.02.2024 | | 500 | 614 | 0,11 |
| HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP | | | | |
| 5,844 % fällig am 29.11.2049 | £ | 1.263 | £ 1.380 | 0,24 |
| HSBC Bank Capital Funding Sterling 2 LP | | | | |
| 5,862 % fällig am 29.04.2049 | | 700 | 734 | 0,13 |
| Kennedy Wilson Europe Real Estate PLC | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | | 700 | 685 | 0,12 |
| | | | 8.748 | 1,53 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.03.2035 | $ | 300 | 198 | 0,04 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | | | | |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 700 | 673 | 0,12 |
| 6,212 % fällig am 22.11.2016 | $ | 600 | 419 | 0,07 |
| Glencore Finance Europe S.A. | | | | |
| 6,500 % fällig am 27.02.2019 | £ | 1.200 | 1.119 | 0,20 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. | | | | |
| 4,950 % fällig am 07.02.2017 | $ | 200 | 137 | 0,02 |
| 5,400 % fällig am 24.03.2017 | | 200 | 138 | 0,02 |
| | | | 2.684 | 0,47 |
| **MEXIKO** | | | | |
| America Movil SAB de C.V. | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.10.2026 | £ | 500 | 558 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 28.06.2030 | | 2.200 | 2.599 | 0,45 |
| Cemex SAB de C.V. | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.01.2021 | $ | 1.800 | 1.178 | 0,21 |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 8,250 % fällig am 02.06.2022 | £ | 200 | 237 | 0,04 |
| | | | 4.572 | 0,80 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Atradius Finance BV | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.09.2044 | € | 3.700 | 2.448 | 0,43 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.05.2029 | £ | 300 | 306 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | | 1.500 | 1.627 | 0,28 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 8.200 | 7.207 | 1,26 |
| 6,910 % fällig am 29.06.2049 | £ | 250 | 301 | 0,05 |
| E.ON International Finance BV | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 4.200 | 4.812 | 0,84 |
| 6,375 % fällig am 07.06.2032 | | 415 | 499 | 0,09 |
| Enel Finance International NV | | | | |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | | 3.700 | 4.395 | 0,77 |
| Koninklijke KPN NV | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.09.2029 | | 3.000 | 3.439 | 0,60 |
| Madrilena Red de Gas Finance BV | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | € | 300 | 262 | 0,05 |
| Nederlandse Waterschapsbank NV | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.06.2032 | £ | 600 | 791 | 0,14 |
| NN Group NV | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2049 | € | 900 | 654 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 08.04.2044 | | 700 | 538 | 0,09 |
| Redexis Gas Finance BV | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2027 | | 1.600 | 1.025 | 0,18 |
| RWE Finance BV | | | | |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | £ | 2.000 | 2.129 | 0,37 |
| 6,250 % fällig am 03.06.2030 | | 4.175 | 4.598 | 0,80 |
| Schaeffler Finance BV | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 700 | 503 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2023 | $ | 1.500 | 1.003 | 0,18 |
| Siemens Financieringsmaatschappij NV | | | | |
| 3,750 % fällig am 10.09.2042 | £ | 2.900 | 2.916 | 0,51 |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 3.600 | 2.584 | 0,45 |
| | | | 42.037 | 7,34 |
| **KATAR** | | | | |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. III | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | $ | 1.200 | 947 | 0,16 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| Temasek Financial I Ltd. | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | £ | 4.450 | 5.782 | 1,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SPANIEN** | | | | | |
| **ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.04.2020 (b) | € | 2.500 | £ | 1.732 | 0,30 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 1.000 | | 725 | 0,13 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 2.600 | | 1.806 | 0,31 |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | | 200 | | 161 | 0,03 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 2.700 | | 1.867 | 0,33 |
| **Iberdrola Finanzas SAU** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.01.2024 | £ | 200 | | 258 | 0,04 |
| | | | | 6.549 | 1,14 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.06.2037 | | 1.700 | | 1.973 | 0,34 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2039 | | 5.800 | | 7.858 | 1,37 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 3.200 | | 4.451 | 0,78 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 5.500 | | 7.551 | 1,32 |
| | | | | 21.833 | 3,81 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **Vattenfall AB** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.03.2077 | € | 2.700 | | 1.602 | 0,28 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 | | 600 | | 483 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | $ | 1.200 | | 879 | 0,15 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 4.200 | | 2.885 | 0,50 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 2.750 | | 2.130 | 0,37 |
| **UBS Group AG** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 2.500 | | 1.937 | 0,34 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 2.100 | | 1.496 | 0,26 |
| | | | | 9.810 | 1,71 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Abbey National Treasury Services PLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2029 | £ | 2.800 | | 2.964 | 0,52 |
| 5,750 % fällig am 02.03.2026 | | 1.200 | | 1.524 | 0,27 |
| **ABP Finance PLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 1.400 | | 1.716 | 0,30 |
| **Affinity Water Finance 2004 Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 13.07.2026 | | 50 | | 62 | 0,01 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | | |
| 4,882 % fällig am 31.12.2032 | | 1.465 | | 1.573 | 0,27 |
| 5,340 % fällig am 30.06.2030 | | 1.900 | | 2.065 | 0,36 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.05.2021 | | 450 | | 573 | 0,10 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 2.750 | | 2.128 | 0,37 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 200 | | 145 | 0,02 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 1.350 | | 1.744 | 0,30 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | | 1.450 | | 1.878 | 0,33 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 400 | | 299 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 2.700 | | 2.705 | 0,47 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 400 | | 321 | 0,06 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 05.07.2040 | £ | 500 | | 625 | 0,11 |
| **BBC Pacific Quay Finance PLC** | | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 954 | | 1.130 | 0,20 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | $ | 5.800 | | 5.764 | 1,01 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | £ | 1.195 | | 1.353 | 0,24 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.12.2028 | | 1.500 | | 1.818 | 0,32 |
| **Canary Wharf Finance II PLC** | | | | | |
| 6,800 % fällig am 22.04.2030 | | 138 | | 170 | 0,03 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 4.000 | | 4.367 | 0,76 |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | £ | 3.250 | £ | 3.566 | 0,62 |
| **Coventry Building Society** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | | 800 | | 775 | 0,13 |
| **CRH Finance UK PLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 02.12.2029 | | 2.400 | | 2.407 | 0,42 |
| **Debenhams PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2021 | | 300 | | 300 | 0,05 |
| **Eastern Power Networks PLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 12.11.2036 | | 3.150 | | 4.187 | 0,73 |
| **Electricity North West Ltd.** | | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.03.2026 | | 300 | | 442 | 0,08 |
| **Enterprise Inns PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 06.10.2023 | | 3.630 | | 3.639 | 0,63 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 3.010 | | 3.100 | 0,54 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 8.705 | | 10.698 | 1,87 |
| **Granite Mortgages 03-2 PLC** | | | | | |
| 1,062 % fällig am 20.07.2043 | | 42 | | 42 | 0,01 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 2,663 % fällig am 15.03.2036 | | 600 | | 520 | 0,09 |
| 3,083 % fällig am 15.12.2033 | | 549 | | 554 | 0,10 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 2.046 | | 2.273 | 0,40 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 3.363 | | 3.800 | 0,66 |
| **Hammerson PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 23.02.2026 | | 2.000 | | 2.418 | 0,42 |
| **High Speed Rail Finance 1 PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.11.2038 | | 3.100 | | 3.367 | 0,59 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | | |
| 4,009 % fällig am 15.10.2054 | | 100 | | 104 | 0,02 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.03.2046 | | 4.300 | | 4.437 | 0,77 |
| 5,375 % fällig am 04.11.2030 | | 1.450 | | 1.576 | 0,27 |
| 5,375 % fällig am 22.08.2033 | | 1.977 | | 2.212 | 0,39 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2025 | € | 1.200 | | 900 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 29.12.2049 | | 2.100 | | 1.530 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 20.12.2027 | £ | 1.100 | | 1.227 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2040 | | 4.973 | | 5.861 | 1,02 |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | | 149 | 0,03 |
| 6,375 % fällig am 29.12.2049 | $ | 400 | | 272 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 17.05.2032 | | 200 | | 173 | 0,03 |
| **Hutchison Whampoa Finance UK PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.11.2026 | £ | 1.000 | | 1.203 | 0,21 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.06.2032 | | 1.600 | | 1.737 | 0,30 |
| 5,500 % fällig am 28.09.2026 | | 2.000 | | 2.337 | 0,41 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 6.500 | | 6.482 | 1,13 |
| **John Lewis PLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 2.022 | | 1.987 | 0,35 |
| **Juturna European Loan Conduit No.16 PLC** | | | | | |
| 5,064 % fällig am 10.08.2033 | | 1.740 | | 1.987 | 0,35 |
| **LBG Capital No.2 PLC** | | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | | 500 | | 681 | 0,12 |
| **LCR Finance PLC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 75 | | 94 | 0,02 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 4.650 | | 4.422 | 0,77 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | | 5.000 | | 5.950 | 1,04 |
| 6,000 % fällig am 08.02.2029 | | 1.400 | | 1.867 | 0,33 |
| 7,625 % fällig am 22.04.2025 | | 3.250 | | 4.169 | 0,73 |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 300 | | 290 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 7.000 | | 7.349 | 1,28 |
| **London Power Networks PLC** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.06.2027 | | 806 | | 1.006 | 0,18 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.03.2034 | | 1.900 | | 2.099 | 0,37 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.07.2026 | | 2.000 | | 2.143 | 0,37 |
| 4,375 % fällig am 08.02.2027 | | 100 | | 112 | 0,02 |
| **National Grid Gas PLC** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 13.05.2038 | | 5.100 | | 6.905 | 1,21 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.09.2021 | | 400 | | 454 | 0,08 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 29.04.2022 | £ | 2.000 | £ | 1.972 | 0,34 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 3.300 | | 4.254 | 0,74 |
| **New Look Secured Issuer PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.07.2022 | | 1.900 | | 1.891 | 0,33 |
| **NGG Finance PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 18.06.2073 | | 2.000 | | 2.068 | 0,36 |
| **Northern Gas Networks Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.06.2027 | | 457 | | 520 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 15.11.2035 | | 150 | | 171 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 23.03.2040 | | 4.806 | | 6.004 | 1,05 |
| **Northern Powergrid Yorkshire PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.07.2032 | | 1.100 | | 1.191 | 0,21 |
| 5,125 % fällig am 04.05.2035 | | 810 | | 956 | 0,17 |
| **RHP Finance PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2048 | | 900 | | 779 | 0,14 |
| **Riverside Finance PLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 05.12.2044 | | 2.400 | | 2.352 | 0,41 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 18.06.2026 | | 1.000 | | 981 | 0,17 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 1.600 | | 1.178 | 0,21 |
| **RSA Insurance Group PLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 10.10.2045 | £ | 2.500 | | 2.429 | 0,42 |
| **Scotland Gas Networks PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.12.2034 | | 1.050 | | 1.193 | 0,21 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 16.01.2026 | | 700 | | 724 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 26.02.2024 | | 64 | | 78 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 07.06.2029 | | 1.423 | | 1.850 | 0,32 |
| **Sky PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.11.2029 | | 2.400 | | 2.422 | 0,42 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 500 | | 517 | 0,09 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 30.09.2030 | | 132 | | 161 | 0,03 |
| **Southern Electric Power Distribution PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 07.06.2032 | | 2.000 | | 2.424 | 0,42 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.03.2029 | | 1.869 | | 2.171 | 0,38 |
| **SP Manweb PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 20.09.2027 | | 3.000 | | 3.407 | 0,59 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | | |
| 1,139 % fällig am 28.12.2028 | | 1.408 | | 1.120 | 0,20 |
| 2,389 % fällig am 28.12.2036 | | 1.630 | | 1.540 | 0,27 |
| 3,289 % fällig am 28.12.2031 | | 1.040 | | 967 | 0,17 |
| 5,472 % fällig am 28.12.2028 | | 2.347 | | 2.382 | 0,42 |
| 6,582 % fällig am 28.12.2027 | | 3.558 | | 3.727 | 0,65 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 18.01.2038 | | 2.092 | | 2.035 | 0,35 |
| 5,125 % fällig am 06.06.2034 | | 4.000 | | 3.600 | 0,63 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2031 | | 3.944 | | 3.849 | 0,67 |
| **Tesco Property Finance 2 PLC** | | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 8.317 | | 7.841 | 1,37 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | | 2.450 | | 2.480 | 0,43 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 2.339 | | 2.338 | 0,41 |
| 6,542 % fällig am 30.03.2021 | | 524 | | 548 | 0,10 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 950 | | 962 | 0,17 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 600 | | 552 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2021 | | 1.400 | | 1.491 | 0,26 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.07.2049 | | 1.200 | | 1.210 | 0,21 |
| **Wellcome Trust Ltd.** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 21.01.2027 | € | 1.500 | | 1.054 | 0,18 |
| 4,000 % fällig am 09.05.2059 | £ | 2.500 | | 3.097 | 0,54 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | | 3.925 | | 5.293 | 0,92 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 2.950 | | 3.737 | 0,65 |
| **Western Power Distribution South West PLC** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2027 | | 1.300 | | 1.590 | 0,28 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Western Power Distribution West Midlands PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 17.10.2024 | £ | 150 | £ 158 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 16.04.2032 | | 100 | 124 | 0,02 |
| **Whitbread Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.10.2025 | | 1.000 | 991 | 0,17 |
| **WM Morrison Supermarkets PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.07.2026 | | 1.050 | 949 | 0,17 |
| | | | 244.055 | 42,62 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Clavis Securities PLC** | | | | |
| 0,022 % fällig am 15.12.2032 | € | 180 | 123 | 0,02 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,017 % fällig am 18.06.2038 | | 68 | 47 | 0,01 |
| **Hercules Eclipse PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | £ | 405 | 399 | 0,07 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 2,202 % fällig am 22.12.2054 | | 900 | 914 | 0,16 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,233 % fällig am 15.12.2049 | | 432 | 416 | 0,08 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 3.118 | 2.131 | 0,37 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 3.138 | 2.819 | 0,49 |
| **Paragon Mortgages No.7 PLC** | | | | |
| 0,339 % fällig am 15.05.2034 | € | 508 | 345 | 0,06 |
| | | | 7.194 | 1,26 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 (b) | £ | 5.000 | 5.352 | 0,93 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (b) | | 9.100 | 10.144 | 1,77 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 (b) | | 15.800 | 18.456 | 3,22 |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 (c)(d) | | 1.159 | 1.188 | 0,21 |
| 4,000 % fällig am 22.01.2060 (b)(e) | | 6.100 | 8.511 | 1,49 |
| | | | 43.651 | 7,62 |
| Summe Großbritannien | | | 294.900 | 51,50 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,136 % fällig am 15.03.2038 | | 3.500 | 3.022 | 0,53 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | $ | 2.550 | £ 1.735 | 0,30 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 9,950 % fällig am 10.11.2038 | | 290 | 316 | 0,05 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.09.2029 | £ | 2.900 | 2.952 | 0,51 |
| 5,500 % fällig am 07.12.2026 | | 2.700 | 3.154 | 0,55 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.06.2043 | | 3.450 | 3.205 | 0,56 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | $ | 500 | 312 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.03.2027 | £ | 550 | 638 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 31.07.2028 | | 5.750 | 7.750 | 1,35 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 21.05.2026 | | 560 | 646 | 0,11 |
| 7,375 % fällig am 01.09.2039 | | 6.000 | 8.974 | 1,57 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.11.2029 | | 1.600 | 1.949 | 0,34 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.10.2023 | | 1.500 | 1.584 | 0,28 |
| **DIRECTV Holdings LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029 | | 600 | 614 | 0,11 |
| **Eli Lilly & Co.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 03.06.2030 | € | 2.000 | 1.467 | 0,26 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 18.09.2037 | £ | 900 | 1.038 | 0,18 |
| 5,375 % fällig am 18.12.2040 | | 600 | 781 | 0,14 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2025 | $ | 2.400 | 1.548 | 0,27 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 07.08.2025 | £ | 1.600 | 2.104 | 0,37 |
| 7,250 % fällig am 10.04.2028 | | 2.850 | 3.869 | 0,67 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.02.2046 | $ | 4.500 | 2.272 | 0,40 |
| 5,300 % fällig am 01.12.2034 | | 200 | 107 | 0,02 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 3.700 | 3.782 | 0,66 |
| **MasterCard, Inc.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 01.12.2027 | € | 1.000 | 750 | 0,13 |
| **Merck & Co., Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 10.02.2045 | $ | 300 | 189 | 0,03 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.09.2026 | £ | 3.000 | 3.138 | 0,55 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Microsoft Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.02.2055 | $ | 900 | £ 550 | 0,10 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.03.2045 | £ | 1.600 | 1.415 | 0,25 |
| 4,500 % fällig am 03.12.2035 | | 900 | 909 | 0,16 |
| **Pfizer, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 03.06.2038 | | 3.000 | 4.152 | 0,72 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | $ | 2.000 | 1.443 | 0,25 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.11.2042 | | 1.300 | 845 | 0,15 |
| 5,850 % fällig am 15.08.2045 | | 200 | 151 | 0,03 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | | |
| 4,450 % fällig am 03.12.2025 | | 300 | 201 | 0,03 |
| **Time Warner Cable, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | | 300 | 160 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | £ | 2.636 | 2.342 | 0,41 |
| **Wal-Mart Stores, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 19.01.2039 | | 855 | 1.009 | 0,18 |
| 5,625 % fällig am 27.03.2034 | | 3.000 | 3.820 | 0,67 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 12.09.2029 | | 2.300 | 2.344 | 0,41 |
| 4,625 % fällig am 02.11.2035 | | 2.579 | 2.914 | 0,51 |
| 4,875 % fällig am 29.11.2035 | | 5.150 | 5.661 | 0,99 |
| **Welltower, Inc.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 20.11.2028 | | 1.900 | 2.005 | 0,35 |
| | | | 84.795 | 14,81 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,771 % fällig am 15.12.2030 | $ | 19 | 13 | 0,00 |
| Summe USA | | | 87.830 | 15,34 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (a)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 50.165 | 340 | 0,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | £ 602.857 | 105,27 |

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

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

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 314 | £ 2 | 0,00 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 802 | (523) | (0,09) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 18 | (2) | 0,00 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 110 | 47 | 0,01 |
| | | | | £ (476) | (0,08) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ (476)** | **(0,08)** |

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

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

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 23.600 | £ (3) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 11.300 | £ 25 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 4.700 | (56) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 9.700 | 22 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 5.200 | (55) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 81.500 | (208) | (0,04) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 14.500 | 33 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 7.000 | 24 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 300 | 45 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 66.600 | (20) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 19.400 | 94 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 4,000 % | 15.09.2030 | 8.500 | (473) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 22.954 | 5 | 0,00 |
| | | | | | £ (564) | (0,10) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (567)** | **(0,10)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

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

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Abertis Infraestructuras S.A. | 1,000 % | 20.03.2020 | JPM | € 3.600 | £ 7 | £ 0 | £ 7 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | BRC | $ 1.500 | (2) | (27) | 25 | 0,00 |
| BP Capital Markets America, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | SOG | € 2.100 | 0 | 6 | (6) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | CBK | 2.900 | (19) | 7 | (26) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | GST | 2.200 | (15) | 8 | (23) | 0,00 |
| Heathrow Funding Ltd. | 1,000 % | 20.06.2021 | JPM | 1.300 | (9) | 5 | (14) | 0,00 |
| HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. | 5,000 % | 20.06.2021 | FBF | 1.800 | 233 | 277 | (44) | 0,04 |
| Pearson PLC | 1,000 % | 20.12.2020 | JPM | 1.400 | 5 | 6 | (1) | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.12.2020 | HUS | $ 13.000 | 57 | (22) | 79 | 0,01 |
| Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | GST | 1.100 | (68) | (55) | (13) | (0,01) |
| SSE PLC | 1,000 % | 20.06.2019 | GST | € 1.200 | 12 | 4 | 8 | 0,00 |
| SSE PLC | 1,000 % | 20.12.2019 | GST | 2.300 | 22 | 14 | 8 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | 4.200 | (4) | (20) | 16 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BOA | 100 | (2) | (5) | 3 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | 400 | (7) | (17) | 10 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | 300 | (5) | (16) | 11 | 0,00 |
| Wendel S.A. | 5,000 % | 20.06.2021 | BRC | 3.100 | 474 | 462 | 12 | 0,08 |
| | | | | | £ 679 | £ 627 | £ 52 | 0,12 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,535 % | 15.05.2045 | MYC | £ 450 | £ 23 | £ 0 | £ 23 | 0,01 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,537 % | 15.05.2045 | BOA | 300 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,543 % | 15.05.2045 | GLM | 300 | 17 | 1 | 16 | 0,00 |
| | | | | | | £ 56 | £ 1 | £ 55 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CNH | 28.761 | $ | 4.366 | SOG | £ 74 | £ (70) | £ 4 | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 2.033.683 | | 1.728 | BRC | 12 | (13) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | MYR | 7.426 | | 1.728 | JPM | 12 | (8) | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 6.481 | £ | 3.112 | JPM | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 340 | € | 467 | BOA | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 831 | £ | 584 | BOA | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 675 | € | 916 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 73.070 | £ | 51.918 | CBK | 0 | (1.982) | (1.982) | (0,35) |
| 02/2016 | £ | 221 | € | 300 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.038 | | 2.815 | HUS | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 2.312 | £ | 1.627 | JPM | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 2.351 | € | 3.259 | SCX | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 1.384 | | 1.273 | SCX | 12 | (12) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 147 | | 200 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.167 | $ | 1.755 | BOA | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2016 | | 869 | | 1.317 | CBK | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.674 | £ | 1.109 | CBK | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| 02/2016 | | 34.772 | | 23.021 | HUS | 0 | (569) | (569) | (0,10) |
| 02/2016 | JPY | 525.400 | | 2.838 | JPM | 0 | (128) | (128) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 728 | | 483 | JPM | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.055 | | 1.357 | MSB | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| 02/2016 | | 1.885 | | 1.242 | SCX | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 201 | $ | 300 | SCX | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 4.353 | JPY | 523.140 | MSB | 87 | (87) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 2.444 | $ | 1.728 | JPM | 12 | (7) | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 62.709 | | 1.728 | MSB | 12 | (20) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 56.950 | | 1.728 | GLM | 12 | (10) | 2 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 30.764 | | 4.755 | SCX | 143 | (3) | 140 | 0,02 |
| | | | | | | £ 523 | £ (3.208) | £ (2.685) | (0,47) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (1.950)** | **(0,34)** |
| **Summe Anlagen** | **£ 599.864** | **104,75** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 28 | £ 19 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 16 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 772 | 524 | 0,09 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 10 | 7 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 6 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 241 | 163 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 210 | 142 | 0,03 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 1 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 232 | 157 | 0,03 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,067 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 4 | 0 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 576 | 424 | 0,07 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 7 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 4 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **£ 1.448** | **0,25** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **£ (28.648)** | **(5,00)** |
| **Nettovermögen** | | | **£ 572.664** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) Der UK Long Term Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 45.892 (auf Basis des Abrechnungsdatums) und Barmittel in Höhe von GBP 224 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 471 und Barmittel in Höhe von GBP 1.881 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 718 und Barmittel in Höhe von GBP 1.790 als Sicherheiten für OTC Swap- und Devisenterminkontrakte verpfändet.**

**(e) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 716 und Barmittel von GBP 1.810 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(f) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 22.211 | £ 580.646 | £ 0 | £ 602.857 |
| Finanzderivate[3] | (476) | (2.517) | 0 | (2.993) |
| **Summen** | **£ 21.735** | **£ 578.129** | **£ 0** | **£ 599.864** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 14.347 | £ 848.736 | £ 0 | £ 863.083 |
| Finanzderivate[3] | 2.095 | 16.162 | 0 | 18.257 |
| **Summen** | **£ 16.442** | **£ 864.898** | **£ 0** | **£ 881.340** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | (0,750 %) | 15.12.2015 | 11.12.2017 | € 1.638 | £ (1.206) | (0,21) |
| SCX | 0,770 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | £ 12.633 | (12.646) | (2,21) |
| SCX | 0,770 % | 10.12.2015 | 11.02.2016 | 13.122 | (13.128) | (2,29) |
| | | | | | £ (26.980) | (4,71) |

**(h) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 0,674 % | 18.12.2015 | 11.02.2016 | £ 1.423 | £ (1.428) | (0,25) |
| BRC | 0,771 % | 11.12.2015 | 11.02.2016 | 17.481 | (17.542) | (3,06) |
| | | | | | £ (18.970) | (3,31) |

(1) In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind GBP 42 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 9 | £ 0 | £ 9 |
| BRC | 464 | (570) | (106) |
| CBK | (2.009) | 1.970 | (39) |
| FBF | 233 | (272) | (39) |
| GLM | 19 | 0 | 19 |
| GST | (49) | 0 | (49) |
| HUS | (473) | 260 | (213) |
| JPM | (285) | 278 | (7) |
| MSB | (45) | 0 | (45) |
| MYC | 23 | 0 | 23 |
| SCX | 159 | 0 | 159 |
| SOG | 4 | 0 | 4 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 105,27 | 96,15 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,08) | 0,23 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,10) | 1,30 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,34) | 0,50 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## UK Long Term Corporate Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 63.000 | £ | 76.478 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 79.400 | | 70.231 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 15.800 | | 18.997 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,450 % fällig am 05.10.2015 | | 9.400 | | 9.380 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 92.700 | | 9.347 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | £ | 6.400 | | 6.764 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.12.2049 | | 5.700 | | 6.522 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,564 % fällig am 29.02.2016 | | 6.500 | | 6.482 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 5,875 % fällig am 19.05.2023 | | 5.750 | | 6.463 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 6.500 | | 6.436 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 4.200 | | 4.985 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 18.09.2037 | | 4.014 | | 4.783 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | | 4.350 | | 4.486 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | | 3.700 | | 4.409 |
| **Co-operative Group Holdings 2011 Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.07.2020 | | 4.100 | | 4.366 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.09.2015 | | 4.000 | | 4.112 |
| **APT Pipelines Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 | | 3.881 | | 3.865 |
| **Eli Lilly & Co.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 03.06.2030 | € | 5.300 | | 3.697 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 3.700 | | 3.695 |
| **RWE Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 2.500 | | 3.542 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 66.200 | £ | 78.517 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 79.400 | | 66.763 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | £ | 16.400 | | 17.339 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 7.500 | | 10.486 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,450 % fällig am 05.10.2015 | | 9.400 | | 9.382 |
| **AB Acquisitions** | | | | |
| 3,985 % fällig am 10.07.2017 | | 7.300 | | 7.300 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 6.484 | | 6.687 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,564 % fällig am 29.02.2016 | | 6.500 | | 6.486 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2017 | | 5.750 | | 6.481 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | | 4.700 | | 6.353 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.12.2027 | | 6.000 | | 6.303 |
| **GE Capital International Funding Co.** | | | | |
| 1,363 % fällig am 15.04.2016 | | 6.037 | | 6.049 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 26.02.2024 | | 4.650 | | 5.984 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 | | 4.300 | | 5.616 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | | 4.700 | | 5.615 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.09.2039 | | 3.649 | | 5.594 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | | 4.000 | | 4.854 |
| **Banco Popolare SC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | € | 6.100 | | 4.720 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 05.12.2025 | £ | 3.964 | | 4.636 |
| **Tesco Property Finance 3 PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 4.631 | | 4.551 |

(a) Der UK Long Term Corporate Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Low Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 2.600 | $ 1.927 | 1,14 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| Ooredoo International Finance Ltd. | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.10.2016 | | 300 | 206 | 0,12 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| Nykredit Realkredit | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.06.2036 | € | 400 | 296 | 0,17 |
| Realkredit Danmark | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 18.700 | 1.847 | 1,10 |
| | | | 2.143 | 1,27 |
| **FINNLAND** | | | | |
| Finland Government Bond | | | | |
| 0,620 % fällig am 25.02.2016 | £ | 1.500 | 1.500 | 0,89 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| Banque PSA Finance S.A. | | | | |
| 5,750 % fällig am 04.04.2021 | $ | 400 | 289 | 0,17 |
| BNP Paribas S.A. | | | | |
| 7,195 % fällig am 29.06.2049 | | 100 | 78 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 1.100 | 767 | 0,45 |
| BPCE S.A. | | | | |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 2.500 | 1.786 | 1,06 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.10.2018 | £ | 1.200 | 1.279 | 0,76 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 600 | 455 | 0,27 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 200 | 139 | 0,08 |
| Dexia Credit Local S.A. | | | | |
| 0,809 % fällig am 15.04.2016 | £ | 2.000 | 2.000 | 1,19 |
| 1,875 % fällig am 17.07.2017 | | 800 | 808 | 0,48 |
| | | | 7.601 | 4,51 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| KFW | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2016 | | 80 | 82 | 0,05 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | | | | |
| 6,625 % fällig am 26.05.2042 | | 100 | 114 | 0,07 |
| NRW Bank | | | | |
| 0,839 % fällig am 17.01.2017 | | 1.000 | 1.001 | 0,59 |
| Land Nordrhein-Westfalen | | | | |
| 1,212 % fällig am 23.05.2016 | | 1.000 | 1.002 | 0,60 |
| | | | 2.199 | 1,31 |
| **IRLAND** | | | | |
| Alpstar CLO 2 PLC | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.05.2024 | € | 600 | 427 | 0,25 |
| Eurocredit CDO V PLC | | | | |
| 0,658 % fällig am 12.09.2022 | | 400 | 293 | 0,18 |
| GE Capital International Funding Co. | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ | 2.210 | 1.488 | 0,88 |
| German Postal Pensions Securitisation 2 PLC | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.01.2017 | € | 200 | 154 | 0,09 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 69.000 | 6.964 | 4,14 |
| | | | 9.326 | 5,54 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| Claris ABS Srl | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | € | 372 | 270 | 0,16 |
| Mars 2600 Srl | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 146 | 108 | 0,06 |
| | | | 378 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| Atrium European Real Estate Ltd. | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2020 | € | 600 | $ 471 | 0,28 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Fiat Chrysler Finance Europe | | | | |
| 7,000 % fällig am 23.03.2017 | | 1.100 | 860 | 0,51 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Bank Nederlandse Gemeenten NV | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.01.2019 | £ | 1.400 | 1.580 | 0,94 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 250 | 220 | 0,13 |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | $ | 400 | 280 | 0,17 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 200 | 146 | 0,09 |
| Duchess VII CLO BV | | | | |
| 0,241 % fällig am 28.02.2023 | € | 1.700 | 1.217 | 0,72 |
| ING Groep NV | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.700 | 1.132 | 0,67 |
| Monastery BV | | | | |
| 0,267 % fällig am 17.11.2044 | € | 271 | 183 | 0,11 |
| Nederlandse Waterschapsbank NV | | | | |
| 1,129 % fällig am 25.01.2016 | £ | 1.800 | 1.801 | 1,07 |
| Panther CDO V BV | | | | |
| 0,312 % fällig am 15.10.2084 | € | 364 | 258 | 0,15 |
| Queen Street CLO II BV | | | | |
| 0,376 % fällig am 15.08.2024 | | 500 | 365 | 0,22 |
| Schaeffler Finance BV | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2020 | | 400 | 298 | 0,18 |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 900 | 617 | 0,36 |
| | | | 8.097 | 4,81 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| Eksportfinans ASA | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.11.2016 | CHF | 100 | 69 | 0,04 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | € | 50 | 33 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 50 | 35 | 0,02 |
| | | | 68 | 0,04 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 500 | 383 | 0,23 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | | 400 | 289 | 0,17 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 11,500 % fällig am 29.10.2049 | | 200 | 161 | 0,10 |
| Banco Santander S.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 800 | 553 | 0,33 |
| Bankia S.A. | | | | |
| 0,147 % fällig am 25.01.2016 | | 600 | 442 | 0,26 |
| Xunta de Galicia | | | | |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | | 100 | 84 | 0,05 |
| | | | 1.529 | 0,91 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| Europäische Investitionsbank | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.10.2018 | £ | 1.900 | 2.080 | 1,24 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| Credit Suisse AG | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | | 1.300 | 1.300 | 0,77 |
| UBS AG | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 600 | 412 | 0,25 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 2.800 | 1.987 | 1,18 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 900 | 697 | 0,41 |
| UBS Group AG | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 214 | 0,13 |
| | | | 4.610 | 2,74 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.04.2017 | £ | 1.100 | $ 1.108 | 0,66 |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 400 | 310 | 0,18 |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 2.700 | 1.958 | 1,16 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 200 | 259 | 0,15 |
| Barclays PLC | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 150 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | £ | 800 | 802 | 0,48 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | € | 200 | 160 | 0,10 |
| Guinness Partnership Ltd. | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.10.2044 | £ | 150 | 151 | 0,09 |
| Heathrow Finance PLC | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.03.2017 | | 300 | 317 | 0,19 |
| Iceland Bondco PLC | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | 177 | 0,10 |
| Imperial Tobacco Finance PLC | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2016 | | 1.100 | 1.140 | 0,68 |
| InterContinental Hotels Group PLC | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 300 | 299 | 0,18 |
| Lloyds Bank PLC | | | | |
| 1,500 % fällig am 02.05.2017 | | 700 | 706 | 0,42 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | | 500 | 525 | 0,31 |
| Manchester Airport Group Funding PLC | | | | |
| 4,125 % fällig am 02.04.2024 | | 100 | 106 | 0,06 |
| National Westminster Bank PLC | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.09.2021 | | 200 | 227 | 0,13 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 1.000 | 736 | 0,44 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 400 | 407 | 0,24 |
| Sky PLC | | | | |
| 2,875 % fällig am 24.11.2020 | | 400 | 405 | 0,24 |
| Tesco PLC | | | | |
| 5,125 % fällig am 10.04.2047 | € | 100 | 62 | 0,04 |
| Virgin Media Secured Finance PLC | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 200 | 184 | 0,11 |
| Virgin Money Holdings UK PLC | | | | |
| 7,875 % fällig am 29.07.2049 | | 800 | 807 | 0,48 |
| Whitbread Group PLC | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.10.2025 | | 100 | 99 | 0,06 |
| | | | 11.095 | 6,59 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Aggregator of Loans Backed by Assets PLC | | | | |
| 1,754 % fällig am 24.04.2049 | | 1.082 | 1.071 | 0,64 |
| Auburn Securities 9 PLC | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 579 | 576 | 0,34 |
| Business Mortgage Finance 5 PLC | | | | |
| 0,953 % fällig am 15.02.2039 | | 18 | 18 | 0,01 |
| Clavis Securities PLC | | | | |
| 0,753 % fällig am 15.12.2032 | | 479 | 447 | 0,27 |
| Darrowby No.2 PLC | | | | |
| 2,271 % fällig am 20.02.2044 | | 116 | 118 | 0,07 |
| Dukinfield PLC | | | | |
| 1,573 % fällig am 15.08.2045 | | 675 | 662 | 0,39 |
| Eurohome UK Mortgages PLC | | | | |
| 0,733 % fällig am 15.06.2044 | | 613 | 571 | 0,34 |
| Eurosail-UK PLC | | | | |
| 0,745 % fällig am 13.03.2045 | | 371 | 355 | 0,21 |
| 1,535 % fällig am 13.06.2045 | | 1.100 | 1.034 | 0,61 |
| Granite Mortgages PLC | | | | |
| 0,449 % fällig am 20.07.2043 | € | 39 | 29 | 0,02 |
| Great Hall Mortgages No.1 PLC | | | | |
| 0,726 % fällig am 18.06.2039 | £ | 199 | 184 | 0,11 |
| Great Hall Mortgages PLC | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | € | 208 | 145 | 0,09 |
| 0,017 % fällig am 18.06.2038 | | 135 | 94 | 0,06 |
| Landmark Mortgage Securities No. 3 PLC | | | | |
| 0,859 % fällig am 17.04.2044 | £ | 869 | 787 | 0,47 |
| Ludgate Funding PLC | | | | |
| 0,741 % fällig am 01.01.2061 | | 516 | 466 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Moorgate Funding Ltd.** | | | | |
| 1,402 % fällig am 15.10.2050 | £ | 851 | $ 832 | 0,49 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 757 | 517 | 0,31 |
| **Paragon Mortgages No.13 PLC** | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | £ | 866 | 778 | 0,46 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,535 % fällig am 12.03.2048 | | 879 | 870 | 0,52 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC** | | | | |
| 0,775 % fällig am 12.12.2036 | | 60 | 55 | 0,03 |
| **Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC** | | | | |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | | 77 | 70 | 0,04 |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 463 | 423 | 0,25 |
| **Residential Mortgage Securities 25 PLC** | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | | 240 | 244 | 0,14 |
| **Residential Mortgage Securities 28 PLC** | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 2.309 | 2.287 | 1,36 |
| **Tenterden Funding PLC** | | | | |
| 2,085 % fällig am 21.03.2044 | | 221 | 224 | 0,13 |
| **Thrones PLC** | | | | |
| 2,082 % fällig am 20.07.2044 | | 262 | 262 | 0,15 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,101 % fällig am 10.10.2040 | € | 194 | $ 142 | 0,08 |
| | | | 13.261 | 7,87 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.09.2017 (b) | £ | 9.700 | 9.757 | 5,79 |
| 1,750 % fällig am 22.01.2017 (b) | | 20.900 | 21.182 | 12,58 |
| 1,750 % fällig am 22.07.2019 (b) | | 18.400 | 18.788 | 11,15 |
| 2,000 % fällig am 22.07.2020 | | 20.800 | 21.401 | 12,71 |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 (c) | | 2.200 | 2.209 | 1,31 |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 (d) | | 8.800 | 9.419 | 5,59 |
| 3,750 % fällig am 07.09.2020 (b) | | 6.000 | 6.673 | 3,96 |
| 4,250 % fällig am 07.06.2032 | | 2.100 | 2.628 | 1,56 |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 3.900 | 4.932 | 2,93 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,540 % fällig am 25.01.2016 (b) | | 164 | 164 | 0,10 |
| | | | 97.153 | 57,68 |
| Summe Großbritannien | | | 121.509 | 72,14 |
| **USA** | | | | |
| **Ahold Finance USA LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 14.03.2017 | | 1.100 | 1.163 | 0,69 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 2,693 % fällig am 26.01.2036 | $ | 123 | $ 69 | 0,04 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,161 % fällig am 30.11.2017 | € | 1.300 | 960 | 0,57 |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.07.2037 | $ | 41 | 26 | 0,02 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | | 859 | 586 | 0,35 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,789 % fällig am 19.07.2035 (e) | | 38 | 22 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 28.09.2016 | £ | 250 | 258 | 0,15 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 300 | 299 | 0,18 |
| **Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 | $ | 2.896 | 1.907 | 1,13 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 5.667 | 3.725 | 2,21 |
| | | | 9.015 | 5,35 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | £ 173.971 | 103,29 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 23 | £ 38 | 0,02 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Long | 03/2016 | 80 | (14) | (0,01) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 60 | (40) | (0,02) |
| | | | | £ (16) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ (16)** | **(0,01)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 2.500 | £ (9) | 0,00 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 47.100 | (87) | (0,05) |
| iTraxx Europe Series 24 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | € 30.700 | (27) | (0,02) |
| | | | | £ (123) | (0,07) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,970 % | 13.02.2016 | £ 7.300 | £ (25) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,950 % | 19.02.2016 | 6.800 | (9) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 54.700 | (50) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 15.06.2018 | 19.800 | 16 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 4.500 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 5.700 | 13 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | € 6.300 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 13.800 | 13 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 2,750 % | 17.09.2029 | 3.850 | 15 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 33.300 | (54) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 13.200 | 50 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 1.900 | (27) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 3,500 % | 21.03.2032 | 16.250 | (518) | (0,31) |
| | | | | | £ (587) | (0,35) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (710)** | **(0,42)** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Low Duration Fund (Forts.)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ZINSSWAPOPTIONEN | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | £ 2.600 | £ (14) | £ (6) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 2.600 | (9) | (11) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 1.600 | (8) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 01.02.2016 | 1.600 | (7) | (1) | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 11.01.2016 | 3.300 | (20) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,350 % | 11.01.2016 | 3.300 | (20) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | £ (78) | £ (19) | (0,01) |

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

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Russia Government International Bond | (1,000 %) | 20.09.2019 | HUS | $ 500 | £ 20 | £ 19 | £ 1 | 0,01 |
| Smiths Group PLC | (1,000 %) | 20.03.2018 | BOA | € 500 | (6) | 1 | (7) | (0,01) |
| Smiths Group PLC | (1,000 %) | 20.06.2018 | BOA | 350 | (5) | 0 | (5) | 0,00 |
| | | | | | £ 9 | £ 20 | £ (11) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF(3)

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Japan Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | RYL | $ 800 | £ 1 | £ 7 | £ (6) | 0,00 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | 2.700 | 19 | (1) | 20 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | 2.150 | 16 | (46) | 62 | 0,01 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.09.2019 | DUB | 7.600 | 54 | (7) | 61 | 0,03 |
| Republik Italien | 1,000 % | 20.03.2019 | MYC | 1.500 | 12 | (28) | 40 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | € 200 | (7) | 0 | (7) | 0,00 |
| | | | | | £ 95 | £ (75) | £ 170 | 0,06 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 3.576 | BRL 13.638 | CBK | £ 0 | £ (87) | £ (87) | (0,05) |
| 01/2016 | BRL 13.638 | $ 3.493 | CBK | 31 | 0 | 31 | 0,02 |
| 01/2016 | 24.248 | 6.188 | DUB | 106 | (66) | 40 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 6.299 | BRL 24.248 | DUB | 0 | (115) | (115) | (0,07) |
| 01/2016 | KRW 657.748 | $ 574 | GLM | 14 | (5) | 9 | 0,01 |
| 02/2016 | $ 6.128 | BRL 24.248 | DUB | 0 | (41) | (41) | (0,02) |
| 02/2016 | CHF 102 | £ 67 | MSB | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | £ 1.888 | DKK 19.075 | CBK | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK 19.120 | £ 1.823 | MSB | 0 | (67) | (67) | (0,04) |
| 02/2016 | € 14.325 | 10.174 | CBK | 0 | (393) | (393) | (0,23) |
| 02/2016 | 2.654 | 1.874 | JPM | 0 | (84) | (84) | (0,05) |
| 02/2016 | £ 113 | € 160 | JPM | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| 02/2016 | 2.326 | $ 3.500 | BOA | 49 | 0 | 49 | 0,03 |
| 02/2016 | $ 37.571 | £ 24.874 | HUS | 0 | (615) | (615) | (0,37) |
| 02/2016 | 497 | 333 | JPM | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 02/2016 | 1.101 | 727 | MSB | 0 | (20) | (20) | (0,01) |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | £ | 1.693 | $ | 2.560 | SCX | £ 44 | £ 0 | £ 44 | 0,03 |
| 02/2016 | HKD | 54 | | 7 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 779 | | 554 | SCX | 8 | (5) | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 19.788 | | 550 | FBF | 8 | (7) | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.814 | | 106 | HUS | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 18.048 | | 553 | UAG | 8 | (4) | 4 | 0,00 |
| 04/2016 | BRL | 5.330 | | 1.566 | DUB | 176 | 0 | 176 | 0,10 |
| 05/2016 | | 4.672 | | 1.338 | CBK | 138 | 0 | 138 | 0,08 |
| 05/2016 | | 15.339 | | 4.353 | MSB | 427 | 0 | 427 | 0,25 |
| | | | | | | £ 1.015 | £ (1.518) | £ (503) | (0,30) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (418)** | **(0,25)** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ | 800 | £ 543 | 0,32 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | | **£ 543** | **0,32** |
| **Summe Anlagen** | | | **£ 173.370** | **102,93** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5.065 | £ 5.065 | 3,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 16 | 11 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 12 | 6 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 926 | 5 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 453 | 307 | 0,18 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 9 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 26 | 26 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 3 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 141 | 96 | 0,06 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 3 | 2 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5 | 5 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 9 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 136 | 92 | 0,06 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 7 | 4 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 9 | 4 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 222 | 164 | 0,10 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 390 | 2 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1.599 | 1.599 | 0,95 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 2 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **£ 7.394** | **4,39** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **£ (12.332)** | **(7,32)** |
| **Nettovermögen** | | | **£ 168.432** | **100,00** |

**ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):**

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

(a) Der UK Low Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 1.108 und Barmittel in Höhe von GBP 1.932 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.

(c) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 682 als Sicherheiten für OTC Swap-, Swaption- und Devisenterminkontrakte verpfändet.

(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 5.137 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.

**(e) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(f) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(g) Barmittel in Höhe von GBP 384 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(h) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 6.964 | £ 167.007 | £ 0 | £ 173.971 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 543 | 0 | 543 |
| Finanzderivate[3] | (16) | (1.128) | 0 | (1.144) |
| **Summen** | **£ 6.948** | **£ 166.422** | **£ 0** | **£ 173.370** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:[2]

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 0 | £ 173.919 | £ 73 | £ 173.992 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 514 | 0 | 514 |
| Finanzderivate[3] | 137 | (741) | 0 | (604) |
| **Summen** | **£ 137** | **£ 173.692** | **£ 73** | **£ 173.902** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**(i) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 0,749 % | 30.11.2015 | 11.02.2016 | £ 435 | £ (437) | (0,26) |
| MYI | 0,799 % | 30.11.2015 | 11.02.2016 | 3.160 | (3.171) | (1,88) |
| SCX | 0,759 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 1.605 | (1.611) | (0,96) |
| | | | | | £ (5.219) | (3,10) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind GBP 10 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 38 | £ 0 | £ 38 |
| BRC | (5) | 0 | (5) |
| CBK | (297) | 331 | 34 |
| DUB | 114 | (330) | (216) |
| FBF | 1 | 0 | 1 |
| GLM | 9 | 0 | 9 |
| HUS | (595) | 351 | (244) |
| JPM | (85) | 0 | (85) |
| MSB | 338 | (350) | (12) |
| MYC | 12 | 0 | 12 |
| RYL | 1 | 0 | 1 |
| SCX | 47 | 0 | 47 |
| UAG | 4 | 0 | 4 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(k) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 103,29 | 95,47 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,01) | 0,08 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,42) | (0,92) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,25) | 0,51 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,32 | 0,28 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## UK Low Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | £ | 30.500 | £ | 33.104 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.07.2020 | | 22.300 | | 23.077 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 7.100 | | 9.217 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2020 | | 7.300 | | 8.144 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 22.01.2017 | | 7.300 | | 7.401 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 7.200 | | 7.242 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 69.000 | | 6.957 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2015 | £ | 5.700 | | 5.686 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 6.500 | | 5.451 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | £ | 4.800 | | 4.819 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 22.07.2019 | | 4.500 | | 4.618 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.09.2017 | | 4.200 | | 4.227 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | $ | 5.685 | | 3.616 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.12.2015 | £ | 3.600 | | 3.592 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2034 | | 2.400 | | 3.296 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 3.700 | | 3.295 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,540 % fällig am 25.01.2016 | £ | 3.000 | | 2.992 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.06.2032 | | 2.100 | | 2.755 |
| **Residential Mortgage Securities 28 PLC** | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 2.522 | | 2.491 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 12.300 | | 2.368 |
| **General Electric Capital Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | $ | 3.000 | | 1.976 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 18.700 | | 1.925 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,470 % fällig am 07.09.2015 | £ | 1.885 | | 1.881 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | £ | 35.600 | £ | 38.346 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 22.07.2019 | | 20.800 | | 21.413 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2020 | | 7.600 | | 8.455 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.10.2024 | € | 9.900 | | 7.691 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | £ | 7.200 | | 7.236 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 7.200 | | 6.121 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | £ | 5.660 | | 5.862 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.10.2015 | | 5.700 | | 5.686 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 4.300 | | 5.592 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 6.500 | | 5.586 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.01.2015 | £ | 3.600 | | 3.601 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.12.2015 | | 3.600 | | 3.592 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2034 | | 2.700 | | 3.480 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 3.700 | | 3.329 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.09.2017 | £ | 3.000 | | 3.021 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,504 % fällig am 26.05.2015 | | 3.000 | | 2.995 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,540 % fällig am 25.01.2016 | | 2.836 | | 2.833 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | | 2.600 | | 2.578 |
| **FMS Wertmanagement** | | | | |
| 0,794 % fällig am 03.08.2015 | | 2.100 | | 2.103 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,470 % fällig am 07.09.2015 | | 1.765 | | 1.761 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 12.300 | | 1.707 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 4,650 % fällig am 30.07.2025 | € | 1.900 | | 1.687 |

(a) Der UK Low Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % OF NETTO-VERMÖ-GEN |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 200 | £ 148 | 0,91 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 200 | 150 | 0,92 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| KFW | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2016 | £ | 70 | 71 | 0,44 |
| Landwirtschaftliche Rentenbank | | | | |
| 3,250 % fällig am 07.12.2016 | | 200 | 205 | 1,26 |
| | | | 276 | 1,70 |
| **IRLAND** | | | | |
| Eurocredit CDO V PLC | | | | |
| 0,658 % fällig am 12.09.2022 | € | 100 | 73 | 0,45 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 8.900 | 899 | 5,53 |
| | | | 972 | 5,98 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| Claris ABS Srl | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | € | 265 | 193 | 1,19 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | | 300 | 263 | 1,61 |
| Mars 2600 Srl | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 146 | 108 | 0,67 |
| UniCredit SpA | | | | |
| 8,000 % fällig am 03.04.2049 | $ | 200 | 129 | 0,79 |
| | | | 693 | 4,26 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| Fiat Chrysler Finance Europe | | | | |
| 7,000 % fällig am 23.03.2017 | € | 100 | 78 | 0,48 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| Queen Street CLO II BV | | | | |
| 0,376 % fällig am 15.08.2024 | | 100 | 73 | 0,45 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % OF NETTO-VERMÖ-GEN |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Bank Nederlandse Gemeenten NV | | | | |
| 0,875 % fällig am 12.12.2016 | £ | 300 | £ 300 | 1,85 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | $ | 100 | 73 | 0,45 |
| Nederlandse Waterschapsbank NV | | | | |
| 2,125 % fällig am 07.09.2016 | £ | 1.770 | 1.789 | 11,00 |
| Schaeffler Finance BV | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2020 | € | 100 | 74 | 0,46 |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 300 | 206 | 1,26 |
| | | | 2.442 | 15,02 |
| Summe Niederlande | | | 2.515 | 15,47 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | | 50 | 33 | 0,20 |
| 7,000 % fällig am 04.03.2016 | | 25 | 18 | 0,11 |
| | | | 51 | 0,31 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| UBS Group AG | | | | |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | | 250 | 178 | 1,10 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,750 % fällig am 10.04.2023 | | 200 | 145 | 0,89 |
| Guinness Partnership Ltd. | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.10.2044 | £ | 100 | 101 | 0,62 |
| Iceland Bondco PLC | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.07.2021 | | 100 | 88 | 0,54 |
| InterContinental Hotels Group PLC | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.08.2025 | | 100 | 100 | 0,61 |
| Scottish Power UK PLC | | | | |
| 6,375 % fällig am 31.05.2041 | | 100 | 129 | 0,80 |
| Telereal Secured Finance PLC | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2031 | | 179 | 175 | 1,08 |
| | | | 738 | 4,54 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Auburn Securities 9 PLC | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 193 | 192 | 1,18 |
| Great Hall Mortgages No.1 PLC | | | | |
| 0,726 % fällig am 18.06.2039 | | 299 | 276 | 1,70 |
| Paragon Mortgages No.13 PLC | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | | 108 | 97 | 0,60 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % OF NETTO-VERMÖ-GEN |
|---|---|---|---|---|
| Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC | | | | |
| 0,775 % fällig am 12.12.2036 | £ | 34 | £ 32 | 0,19 |
| Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC | | | | |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | | 38 | 35 | 0,22 |
| 0,755 % fällig am 12.06.2044 | | 231 | 211 | 1,30 |
| Residential Mortgage Securities 25 PLC | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | | 120 | 122 | 0,75 |
| Residential Mortgage Securities 28 PLC | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 171 | 170 | 1,04 |
| | | | 1.135 | 6,98 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| United Kingdom Gilt (b) | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | | 300 | 321 | 1,97 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 555 | 648 | 3,99 |
| United Kingdom Gilt Inflation-Linked (c) | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | | 2.387 | 2.533 | 15,58 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 | | 166 | 206 | 1,26 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 468 | 749 | 4,60 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (b) | | 880 | 1.449 | 8,91 |
| 0,500 % fällig am 22.03.2050 (b) | | 924 | 1.354 | 8,33 |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (b) | | 419 | 560 | 3,44 |
| 0,750 % fällig am 22.03.2034 (b) | | 838 | 1.055 | 6,49 |
| 1,125 % fällig am 22.11.2037 (b) | | 1.347 | 1.909 | 11,74 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (b) | | 1.016 | 1.355 | 8,34 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2055 | | 1.148 | 2.209 | 13,59 |
| 2,000 % fällig am 26.01.2035 (b) | | 1.379 | 3.102 | 19,08 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 1 | 2 | 0,01 |
| | | | 17.452 | 107,33 |
| Summe Großbritannien | | | 19.325 | 118,85 |
| **USA** | | | | |
| SLM Student Loan Trust | | | | |
| 0,347 % fällig am 25.10.2039 | € | 280 | 175 | 1,08 |
| Treasury Inflation Protected Securities (c) | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 | $ | 827 | 545 | 3,35 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | | 600 | 359 | 2,20 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.01.2045 | | 18 | 11 | 0,07 |
| | | | 1.090 | 6,70 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **£ 25.476** | **156,68** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 13 | £ 22 | 0,13 |
| United Kingdom Treasury 10-Year Gilt March Futures | Short | 03/2016 | 13 | 3 | 0,02 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 6 | (3) | (0,02) |
| | | | | £ 22 | 0,13 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ 22** | **0,13** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 1.000 | £ (7) | (0,04) |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,970 % | 13.02.2016 | £ 5.000 | £ (17) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,950 % | 19.02.2016 | 4.600 | (15) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 7.000 | (2) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 15.06.2018 | 1.900 | 1 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 16.12.2025 | 1.000 | (2) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 600 | (8) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,150 % | 16.03.2018 | € 2.020 | 5 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | 200 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 750 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 5.200 | (2) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 3.900 | (14) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 400 | (6) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 1.300 | (21) | (0,13) |
| | | | | | £ (78) | (0,48) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (85)** | **(0,52)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## OPTIONSKAUF

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | € 600 | £ 6 | £ 5 | 0,03 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | 1.400 | 15 | 13 | 0,08 |
| | | | | | | | £ 21 | £ 18 | 0,11 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | € 250 | £ (6) | £ (7) | (0,04) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | 550 | (15) | (14) | (0,09) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 300 | (2) | (1) | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 300 | (1) | (1) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 01.02.2016 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,300 % | 01.02.2016 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | £ (30) | £ (23) | (0,14) |

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

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Russia Government International Bond | (1,000 %) | 20.09.2019 | HUS | $ 300 | £ 12 | £ 11 | £ 1 | 0,07 |
| Smiths Group PLC | (1,000 %) | 20.06.2018 | BOA | € 150 | (2) | 1 | (3) | (0,01) |
| | | | | | £ 10 | £ 12 | £ (2) | 0,06 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF(3)

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag(2) | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. | 5,000 % | 20.12.2018 | FBF | € 200 | £ 18 | £ 24 | £ (6) | 0,11 |
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | 100 | (4) | (1) | (3) | (0,02) |
| | | | | | £ 14 | £ 23 | £ (9) | 0,09 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Real Return Fund (Forts.)

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 805 | BRL | 3.072 | CBK | £ 0 | £ (20) | £ (20) | (0,12) |
| 01/2016 | BRL | 3.072 | $ | 787 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 242 | BRL | 917 | DUB | 0 | (7) | (7) | (0,04) |
| 01/2016 | BRL | 917 | $ | 235 | DUB | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 01/2016 | | 38 | | 10 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10 | BRL | 38 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 52 | CNY | 335 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 91.870 | $ | 80 | GLM | 2 | (1) | 1 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 11 | £ | 8 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.540 | | 1.094 | CBK | 0 | (42) | (42) | (0,26) |
| 02/2016 | | 10 | $ | 11 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 253 | £ | 179 | JPM | 0 | (8) | (8) | (0,05) |
| 02/2016 | £ | 10 | € | 14 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 9 | | 12 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 12 | £ | 8 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 12 | € | 17 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 713 | $ | 1.071 | BOA | 13 | 0 | 13 | 0,08 |
| 02/2016 | $ | 287 | £ | 192 | BOA | 0 | (2) | (2) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 23 | $ | 35 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 3.756 | £ | 2.487 | HUS | 0 | (61) | (61) | (0,38) |
| 02/2016 | | 201 | | 133 | JPM | 0 | (3) | (3) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 27 | $ | 40 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 189 | £ | 125 | MSB | 0 | (3) | (3) | (0,02) |
| 02/2016 | £ | 173 | $ | 262 | SCX | 5 | 0 | 5 | 0,03 |
| 02/2016 | SGD | 109 | | 77 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | THB | 2.757 | | 77 | FBF | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8 | THB | 288 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 2.529 | $ | 77 | GLM | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 04/2016 | $ | 318 | BRL | 1.307 | DUB | 4 | (3) | 1 | 0,01 |
| 04/2016 | BRL | 1.307 | $ | 384 | DUB | 43 | 0 | 43 | 0,27 |
| 05/2016 | | 2.891 | | 821 | MSB | 80 | 0 | 80 | 0,50 |
| 05/2016 | $ | 702 | BRL | 2.891 | MSB | 11 | (11) | 0 | 0,00 |
| 10/2016 | CNH | 3.175 | $ | 488 | CBK | 12 | 0 | 12 | 0,08 |
| 01/2016 | $ | 488 | CNH | 3.175 | HUS | 0 | (13) | (13) | (0,08) |
| | | | | | | £ 183 | £ (176) | £ 7 | 0,04 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£** | **26** | **0,16** |
| **Summe Anlagen** | **£** | **25.439** | **156,45** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 118 | £ 118 | 0,73 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 1 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 3 | 2 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 75 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 55 | 38 | 0,23 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 17 | 12 | 0,07 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 9 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 17 | 11 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2 | £ 1 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 15 | 11 | 0,07 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 32 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 37 | 37 | 0,23 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **£ 233** | **1,43** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **£ (9.413)** | **(57,88)** |
| **Nettovermögen** | | | **£ 16.259** | **100,00** |

ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der UK Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 9.804 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(d) **Barmittel in Höhe von GBP 232 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(e) **Barmittel in Höhe von GBP 70 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(f) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 899 | £ 24.577 | £ 0 | £ 25.476 |
| Finanzderivate[3] | 22 | (59) | 0 | (37) |
| **Summen** | **£ 921** | **£ 24.518** | **£ 0** | **£ 25.439** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 2.321 | £ 64.841 | £ 0 | £ 67.162 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 386 | 0 | 386 |
| Finanzderivate[3] | 30 | (283) | 0 | (253) |
| **Summen** | **£ 2.351** | **£ 64.944** | **£ 0** | **£ 67.295** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

(g) **Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 0,840 % | 23.10.2015 | 21.01.2016 | £ 8.669 | £ (8.683) | (53,41) |
| SCX | 0,760 % | 07.12.2015 | 11.02.2016 | 619 | (620) | (3,81) |
| | | | | | £ (9.303) | (57,22) |

(h) **Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MBC | 0,879 % | 11.12.2015 | 21.01.2016 | £ 230 | £ (230) | (1,42) |
| SCX | 0,635 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 346 | (347) | (2,13) |
| | | | | | £ (577) | (3,55) |

(1) In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind GBP 1 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 9 | £ 0 | £ 9 |
| BRC | (6) | 0 | (6) |
| CBK | (42) | 0 | (42) |
| DUB | 38 | (20) | 18 |
| FBF | 18 | 0 | 18 |
| HUS | (62) | 0 | (62) |
| JPM | (11) | 0 | (11) |
| MSB | 77 | (40) | 37 |
| MYC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 6 | 0 | 6 |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 156,68 | 132,99 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,13 | 0,06 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,52) | (1,44) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,16 | 0,88 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,76 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## UK Real Return Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | £ | 6.479 | £ | 7.154 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | | 5.500 | | 6.058 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | 4.800 | | 5.655 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (b) | | 2.792 | | 3.724 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | | 3.470 | | 3.589 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (b) | | 2.345 | | 3.200 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2016 | | 2.500 | | 2.493 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 2.200 | | 2.214 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 07.09.2016 | | 1.770 | | 1.791 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 1.075 | | 1.252 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (b) | | 619 | | 1.026 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 2,000 % fällig am 26.01.2035 (b) | | 400 | | 968 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 8.900 | | 898 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 900 | | 753 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 3.900 | | 746 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.03.2025 | € | 800 | | 712 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | £ | 690 | | 695 |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 4.900 | | 504 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,490 % fällig am 07.12.2015 | £ | 500 | | 499 |
| **Bank Nederlandse Gemeenten NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 12.12.2016 | | 300 | | 300 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,750 % fällig am 22.03.2034 (b) | £ | 8.239 | £ | 10.742 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | | 9.575 | | 10.558 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | | 6.472 | | 7.032 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | 5.800 | | 6.883 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (b) | | 4.884 | | 6.655 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (b) | | 4.254 | | 5.551 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.09.2016 | | 3.470 | | 3.579 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 4.100 | | 3.427 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.11.2055 (b) | £ | 1.413 | | 2.907 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.03.2050 (b) | | 1.807 | | 2.823 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (b) | | 1.589 | | 2.772 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 2,000 % fällig am 26.01.2035 (b) | | 1.100 | | 2.606 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2016 | | 2.500 | | 2.495 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 23.000 | | 2.321 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | £ | 2.200 | | 2.214 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (b) | | 1.310 | | 1.823 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.11.2042 (b) | | 1.210 | | 1.796 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.09.2034 | | 1.300 | | 1.690 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (b) | | 900 | | 1.447 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.03.2052 (b) | | 851 | | 1.200 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 31.01.2023 | € | 1.300 | | 1.186 |
| **United Kingdom Gilt Inflation-Linked** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.11.2037 (b) | | £ 766 | | 1.130 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | $ | 1.762 | | 1.120 |

(a) Der UK Real Return Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Sterling Long Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BELGIEN** | | | | |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | $ | 200 | $ 148 | 0,92 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| Realkredit Danmark | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 2.300 | 227 | 1,41 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.03.2027 | € | 300 | 212 | 1,32 |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | | 100 | 76 | 0,47 |
| | | | 288 | 1,79 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| Alpstar CLO 2 PLC | | | | |
| 0,319 % fällig am 15.05.2024 | | 100 | 71 | 0,44 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 16.000 | 1.615 | 10,05 |
| Summe Irland | | | 1.686 | 10,49 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| Banco Popolare SC | | | | |
| 3,500 % fällig am 14.03.2019 | € | 100 | 76 | 0,47 |
| Claris ABS Srl | | | | |
| 0,354 % fällig am 31.10.2060 | | 106 | 77 | 0,48 |
| Mars 2600 Srl | | | | |
| 1,247 % fällig am 25.10.2050 | | 73 | 54 | 0,34 |
| | | | 207 | 1,29 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 100 | 88 | 0,55 |
| Queen Street CLO II BV | | | | |
| 0,376 % fällig am 15.08.2024 | | 100 | 73 | 0,46 |
| RWE Finance BV | | | | |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 100 | 107 | 0,66 |
| Schaeffler Finance BV | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2020 | | 100 | 74 | 0,46 |
| Vonovia Finance BV | | | | |
| 3,200 % fällig am 02.10.2017 | $ | 450 | 308 | 1,92 |
| | | | 650 | 4,05 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| Slovenia Government International Bond | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | € | 400 | 306 | 1,91 |
| **SPANIEN** | | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | $ 145 | 0,90 |
| Banco Santander S.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 100 | 69 | 0,43 |
| Spain Government Bond | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 200 | 173 | 1,08 |
| Xunta de Galicia | | | | |
| 6,964 % fällig am 28.12.2017 | | 200 | 167 | 1,04 |
| | | | 554 | 3,45 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| Credit Suisse AG | | | | |
| 0,979 % fällig am 15.07.2016 | £ | 250 | 250 | 1,56 |
| UBS AG | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | $ | 200 | 137 | 0,86 |
| UBS Group AG | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 200 | 155 | 0,96 |
| | | | 542 | 3,38 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Abbey National Treasury Services PLC | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.10.2029 | | 100 | 106 | 0,66 |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | | 100 | 129 | 0,80 |
| Barclays PLC | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | | 200 | 160 | 0,99 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 100 | 74 | 0,46 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 200 | 135 | 0,84 |
| Tesco Property Finance 2 PLC | | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 92 | 86 | 0,54 |
| | | | 690 | 4,29 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Auburn Securities 9 PLC | | | | |
| 1,574 % fällig am 18.08.2047 | | 97 | 96 | 0,60 |
| Business Mortgage Finance 5 PLC | | | | |
| 0,953 % fällig am 15.02.2039 | | 117 | 114 | 0,71 |
| Great Hall Mortgages PLC | | | | |
| 0,716 % fällig am 18.03.2039 | | 88 | 84 | 0,52 |
| Hercules Eclipse PLC | | | | |
| 0,819 % fällig am 25.10.2018 | | 46 | 45 | 0,28 |
| Paragon Mortgages No.13 PLC | | | | |
| 0,819 % fällig am 15.01.2039 | | 54 | 48 | 0,30 |
| Precise Mortgage Funding PLC | | | | |
| 1,535 % fällig am 12.03.2048 | | 98 | 97 | 0,60 |
| Residential Mortgage Acceptance Corporation PLC | | | | |
| 0,005 % fällig am 12.06.2037 | € | 11 | 7 | 0,05 |
| 0,775 % fällig am 12.12.2036 | £ | 17 | 16 | 0,10 |
| Residential Mortgage Acceptance Corporation Securities No.1 PLC | | | | |
| 0,025 % fällig am 12.06.2044 | € | 37 | 25 | 0,16 |
| 0,735 % fällig am 12.06.2044 | £ | 67 | 61 | 0,38 |
| Residential Mortgage Securities 25 PLC | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | £ | 90 | $ 92 | 0,57 |
| Residential Mortgage Securities 28 PLC | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2046 | | 86 | 85 | 0,53 |
| Uropa Securities PLC | | | | |
| 0,101 % fällig am 10.10.2040 | € | 194 | 142 | 0,88 |
| | | | 912 | 5,68 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| United Kingdom Gilt | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | £ | 900 | 963 | 6,00 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | 480 | 535 | 3,33 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 815 | 952 | 5,92 |
| 3,750 % fällig am 22.07.2052 | | 500 | 641 | 3,99 |
| 4,250 % fällig am 07.06.2032 | | 100 | 125 | 0,78 |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 | | 43 | 55 | 0,34 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 (b) | | 1.550 | 2.005 | 12,48 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 (b) | | 2.570 | 3.454 | 21,50 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2055 (b) | | 1.550 | 2.226 | 13,86 |
| 4,500 % fällig am 07.12.2042 (c) | | 900 | 1.222 | 7,60 |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 (b) | | 2.571 | 3.518 | 21,90 |
| 5,000 % fällig am 07.03.2025 | | 100 | 127 | 0,79 |
| | | | 15.823 | 98,49 |
| Summe Großbritannien | | | 17.425 | 108,46 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Amgen, Inc. | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2043 | $ | 50 | 36 | 0,22 |
| Discovery Communications LLC | | | | |
| 1,900 % fällig am 19.03.2027 | € | 100 | 62 | 0,39 |
| Kinder Morgan, Inc. | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.03.2027 | | 100 | 54 | 0,33 |
| | | | 152 | 0,94 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp. | | | | |
| 2,265 % fällig am 25.06.2033 | $ | 320 | 212 | 1,32 |
| Reperforming Loan REMIC Trust | | | | |
| 0,561 % fällig am 25.06.2035 | | 129 | 77 | 0,48 |
| | | | 289 | 1,80 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| Fannie Mae | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.12.2028 | £ | 900 | 1.150 | 7,16 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| Treasury Inflation Protected Securities (d) | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (c) | $ | 1.965 | 1.294 | 8,06 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 201 | 132 | 0,82 |
| | | | 1.426 | 8,88 |
| Summe USA | | | 3.017 | 18,78 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **£ 25.050** | **155,93** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 4 | £ (7) | (0,05) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 16 | (9) | (0,05) |
| | | | | £ (16) | (0,10) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 110,000 | 19.02.2016 | 5 | £ 0 | £ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **£ (16)** | **(0,10)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Series 24 Index | (1,000 %) | 20.12.2020 | € 400 | £ 1 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[3]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 650 | £ 1 | 0,01 |
| CDX.IG-25 Index | 1,000 % | 20.12.2020 | 4.600 | (2) | (0,01) |
| | | | | £ (1) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,970 % | 13.02.2016 | £ 2.200 | £ (8) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month GBP-LIBOR | 0,950 % | 19.02.2016 | 2.000 | (7) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | $ 13.000 | (6) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 15.06.2018 | 3.600 | 3 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 800 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,500 % | 16.03.2021 | € 1.000 | (1) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | 275 | (1) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,500 % | 16.03.2046 | 50 | 2 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 16.03.2018 | £ 5.200 | (2) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 % | 16.03.2021 | 3.000 | (17) | (0,10) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | 250 | (3) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | 685 | (11) | (0,07) |
| | | | | | £ (52) | (0,33) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (52)** | **(0,33)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | € 200 | £ 2 | £ 2 | 0,01 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Zahlung | 1,000 % | 01.09.2016 | 600 | 7 | 5 | 0,04 |
| | | | | | | | £ 9 | £ 7 | 0,05 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Sterling Long Average Duration Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | GLM | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | € 80 | £ (2) | £ (2) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month EURIBOR | Erhalt | 1,450 % | 01.09.2016 | 250 | (7) | (7) | (0,04) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,800 % | 12.01.2016 | £ 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,400 % | 12.01.2016 | 200 | (2) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,700 % | 10.03.2016 | 300 | (2) | (1) | (0,01) |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | BRC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,250 % | 10.03.2016 | 300 | (1) | (1) | (0,01) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month GBP-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 11.01.2016 | 400 | (3) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 6-Month GBP-LIBOR | Zahlung | 2,350 % | 11.01.2016 | 400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | £ (21) | £ (11) | (0,07) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | £ 1,750 | 01.02.2016 | 200.000 | £ (1) | £ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | JPM | 2,300 | 01.02.2016 | 200.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | £ (2) | £ 0 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Russia Government International Bond | (1,000 %) | 20.09.2019 | HUS | $ 100 | £ 4 | £ 4 | £ 0 | 0,02 |
| Smiths Group PLC | (1,000 %) | 20.03.2018 | BOA | € 300 | (4) | 0 | (4) | (0,02) |
| | | | | | £ 0 | £ 4 | £ (4) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[3]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HeidelbergCement Finance Luxembourg S.A. | 5,000 % | 20.12.2018 | FBF | € 100 | £ 9 | £ 12 | £ (3) | 0,06 |
| Japan Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | RYL | $ 1.000 | 2 | 9 | (7) | 0,01 |
| | | | | | £ 11 | £ 21 | £ (10) | 0,07 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 537 | BRL | 2.048 | CBK | £ 0 | £ (13) | £ (13) | (0,08) |
| 01/2016 | BRL | 2.048 | $ | 524 | CBK | 5 | 0 | 5 | 0,03 |
| 01/2016 | | 2.405 | | 614 | DUB | 11 | (7) | 4 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 619 | BRL | 2.405 | DUB | 0 | (8) | (8) | (0,05) |
| 01/2016 | KRW | 76.895 | $ | 67 | GLM | 2 | (1) | 1 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 68 | KRW | 77.062 | JPM | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 02/2016 | | 608 | BRL | 2.405 | DUB | 0 | (4) | (4) | (0,03) |
| 02/2016 | £ | 232 | DKK | 2.345 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 2.355 | £ | 225 | MSB | 0 | (8) | (8) | (0,05) |
| 02/2016 | £ | 75 | € | 103 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| 02/2016 | € | 3.442 | £ | 2.445 | CBK | 0 | (95) | (95) | (0,59) |
| 02/2016 | | 10 | $ | 11 | JPM | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 248 | £ | 175 | JPM | 0 | (8) | (8) | (0,05) |
| 02/2016 | £ | 13 | € | 18 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 146 | | 200 | SCX | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 101 | £ | 67 | BOA | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 556 | $ | 837 | BOA | 11 | 0 | 11 | 0,07 |
| 02/2016 | $ | 4.342 | £ | 2.875 | HUS | 0 | (71) | (71) | (0,44) |
| 02/2016 | | 94 | | 63 | JPM | 0 | (1) | (1) | (0,01) |
| 02/2016 | £ | 17 | $ | 26 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 349 | £ | 230 | MSB | 0 | (6) | (6) | (0,04) |
| 02/2016 | £ | 167 | $ | 253 | SCX | 4 | 0 | 4 | 0,03 |
| 02/2016 | THB | 2.231 | | 62 | HUS | 1 | (1) | 0 | 0,00 |

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 04/2016 | BRL | 730 | $ | 210 | CBK | £ 21 | £ 0 | £ 21 | 0,13 |
| 04/2016 | | 201 | | 59 | DUB | 7 | 0 | 7 | 0,04 |
| 05/2016 | | 1.606 | | 456 | MSB | 45 | 0 | 45 | 0,28 |
| 10/2016 | $ | 267 | CNH | 1.737 | BPS | 0 | (7) | (7) | (0,04) |
| 10/2016 | CNH | 1.737 | $ | 267 | CBK | 7 | 0 | 7 | 0,04 |
| | | | | | | £ 117 | £ (234) | £ (117) | (0,73) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (110)** | **(0,68)** |
| **Summe Anlagen** | **£ 24.872** | **154,82** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 91 | £ 91 | 0,57 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 3 | 2 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 2 | 1 | 0,01 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 155 | 1 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 79 | 54 | 0,34 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 0 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 2 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 2 | 0 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 25 | 17 | 0,11 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,498 % fällig am 04.01.2016 | ZAR | 9 | 0 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 24 | 16 | 0,10 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 1 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 7 | 3 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 6 | 4 | 0,03 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 65 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 29 | 29 | 0,18 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 0 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **£ 221** | **1,38** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **£ (9.027)** | **(56,20)** |
| **Nettovermögen** | | | **£ 16.066** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Der UK Sterling Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(b) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 9.384 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(c) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 116 und Barmittel in Höhe von GBP 143 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(e) **Barmittel in Höhe von GBP 41 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(f) **Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 1.615 | £ 23.435 | £ 0 | £ 25.050 |
| Finanzderivate[3] | (16) | (162) | 0 | (178) |
| **Summen** | **£ 1.599** | **£ 23.273** | **£ 0** | **£ 24.872** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des UK Sterling Long Average Duration Fund (Forts.)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 283 | £ 32.031 | £ 0 | £ 32.314 |
| Finanzderivate[3] | (4) | 168 | 0 | 164 |
| **Summen** | **£ 279** | **£ 32.199** | **£ 0** | **£ 32.478** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 0,637 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | £ 1.941 | £ (1.950) | (12,14) |
| IND | 0,643 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 1.668 | (1.675) | (10,43) |
| IND | 0,647 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 2.793 | (2.805) | (17,46) |
| IND | 0,749 % | 30.11.2015 | 11.02.2016 | 139 | (140) | (0,87) |
| MEI | 0,719 % | 11.11.2015 | 11.02.2016 | 625 | (628) | (3,91) |
| SCX | 0,673 % | 12.11.2015 | 11.02.2016 | 2.128 | (2.137) | (13,30) |
| | | | | | £ (9.335) | (58,11) |

(1) In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag sind GBP 26 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(h) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 5 | £ 0 | £ 5 |
| BPS | (7) | 0 | (7) |
| BRC | (2) | 0 | (2) |
| CBK | (74) | 0 | (74) |
| DUB | (1) | (30) | (31) |
| FBF | 9 | 0 | 9 |
| GLM | 1 | 0 | 1 |
| HUS | (67) | 0 | (67) |
| JPM | (11) | 0 | (11) |
| MSB | 31 | (30) | 1 |
| MYC | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 2 | 0 | 2 |
| SCX | 6 | 0 | 6 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(i) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 155,93 | 155,63 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,10) | (0,02) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,33) | (0,50) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,68) | 1,31 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## UK Sterling Long Average Duration Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 6.930 | £ | 8.267 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | | 4.350 | | 4.759 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 | | 2.645 | | 3.612 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.12.2055 | | 2.000 | | 2.938 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 | | 2.000 | | 2.743 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,460 % fällig am 12.10.2015 | | 2.400 | | 2.394 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 16.000 | | 1.614 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2042 | £ | 830 | | 1.120 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.100 | | 1.107 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | | 1.050 | | 1.057 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 885 | | 1.034 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 1.000 | | 836 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.01.2060 | £ | 500 | | 750 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.07.2052 | | 500 | | 660 |
| **KFW** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2016 | | 560 | | 575 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 31.01.2023 | € | 600 | | 545 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,490 % fällig am 14.12.2015 | £ | 500 | | 499 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 2.600 | | 494 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,490 % fällig am 07.12.2015 | £ | 400 | | 399 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 400 | | 361 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 9.350 | £ | 11.125 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 | | 6.700 | | 7.334 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.12.2055 | | 4.504 | | 6.617 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 | | 2.000 | | 2.736 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | € | 3.000 | | 2.568 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,460 % fällig am 12.10.2015 | £ | 2.400 | | 2.397 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.04.2017 | | 2.300 | | 2.320 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 31.01.2023 | € | 1.300 | | 1.191 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2042 | | £ 830 | | 1.119 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2016 | | 1.100 | | 1.106 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | | 1.050 | | 1.051 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.01.2060 | | 500 | | 701 |
| **Spain Government Bond** | | | | |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | € | 800 | | 686 |
| **KFW** | | | | |
| 3,750 % fällig am 07.09.2016 | £ | 560 | | 574 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,490 % fällig am 14.12.2015 | | 500 | | 499 |
| **United Kingdom Treasury Bills** | | | | |
| 0,490 % fällig am 07.12.2015 | | 400 | | 399 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 2.600 | | 361 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 2.800 | | 282 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 | £ | 200 | | 268 |
| **Bankia S.A.** | | | | |
| 0,147 % fällig am 25.01.2016 | € | 300 | | 218 |

(a) Der UK Sterling Long Average Duration Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| PIMCO US Short-Term Fund (i) | | 8.063.144 | $ 80.631 | 2,68 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| Avago Technologies Cayman Ltd. | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | $ | 2.700 | 2.671 | 0,09 |
| Chrysler Group LLC | | | | |
| 3,500 % fällig am 24.05.2017 | | 8.270 | 8.255 | 0,27 |
| Community Health Systems, Inc. | | | | |
| 3,657 % fällig am 31.12.2018 | | 1.975 | 1.950 | 0,07 |
| Dell International LLC | | | | |
| 3,750 % fällig am 29.10.2018 | | 4.216 | 4.209 | 0,14 |
| FMG Resources August 2006 Pty Ltd. | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.06.2019 | | 9.387 | 7.047 | 0,23 |
| HCA, Inc. | | | | |
| 3,174 % fällig am 31.03.2017 | | 10.834 | 10.833 | 0,36 |
| Hilton Worldwide Finance LLC | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.10.2020 | | 5.886 | 5.881 | 0,20 |
| PVH Corp. | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.02.2020 | | 843 | 848 | 0,03 |
| | | | 41.694 | 1,39 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| ABN AMRO Bank NV | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | | 800 | 799 | 0,03 |
| AGFC Capital Trust I | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2067 | | 3.100 | 2.186 | 0,07 |
| American Express Co. | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.03.2018 | | 600 | 666 | 0,02 |
| Banco Popolare SC | | | | |
| 2,375 % fällig am 22.01.2018 | € | 31.200 | 34.106 | 1,13 |
| Banco Popular Espanol S.A. | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 22.400 | 22.935 | 0,76 |
| Banco Santander S.A. | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | | 1.600 | 1.631 | 0,05 |
| Bank of America Corp. | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 58.000 | 3.602 | 0,12 |
| 0,692 % fällig am 15.08.2016 | $ | 10.700 | 10.651 | 0,35 |
| 1,656 % fällig am 22.03.2018 | | 3.000 | 3.011 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 11.01.2018 | | 400 | 400 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 6.300 | 6.518 | 0,22 |
| 5,000 % fällig am 13.05.2021 | | 200 | 219 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 09.11.2016 | £ | 1.650 | 2.507 | 0,08 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | $ | 6.500 | 6.993 | 0,23 |
| 5,700 % fällig am 24.01.2022 | | 100 | 113 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.12.2017 | | 7.900 | 8.455 | 0,28 |
| 6,400 % fällig am 28.08.2017 | | 200 | 214 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.08.2016 | | 935 | 962 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | | 14.600 | 16.116 | 0,54 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2018 | | 800 | 899 | 0,03 |
| Bank of America N.A. | | | | |
| 0,792 % fällig am 15.06.2016 | | 1.000 | 1.000 | 0,03 |
| Bank of Scotland Capital Funding LP | | | | |
| 7,754 % fällig am 29.03.2049 | £ | 3.300 | 5.598 | 0,19 |
| Barclays Bank PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 4.700 | 5.361 | 0,18 |
| 7,700 % fällig am 29.04.2049 | | 5.000 | 5.433 | 0,18 |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 9.140 | 11.860 | 0,39 |
| 14,000 % fällig am 29.11.2049 | £ | 11.700 | 22.338 | 0,74 |
| Bear Stearns Cos. LLC | | | | |
| 6,400 % fällig am 02.10.2017 | $ | 3.905 | 4.206 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 01.02.2018 | | 3.000 | 3.310 | 0,11 |
| BFC Finance Corp. | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.12.2017 | | 518 | 536 | 0,02 |
| BNP Paribas S.A. | | | | |
| 0,804 % fällig am 07.05.2017 | | 70.000 | 69.948 | 2,33 |
| BPCE S.A. | | | | |
| 5,150 % fällig am 21.07.2024 | | 13.100 | 13.233 | 0,44 |
| Citigroup, Inc. | | | | |
| 1,027 % fällig am 10.03.2017 | | 12.600 | 12.573 | 0,42 |
| 1,280 % fällig am 25.07.2016 | $ | 100 | $ 100 | 0,00 |
| 3,953 % fällig am 15.06.2016 | | 1.600 | 1.622 | 0,05 |
| Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA | | | | |
| 8,375 % fällig am 29.07.2049 | | 3.900 | 4.024 | 0,13 |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 800 | 862 | 0,03 |
| 11,000 % fällig am 29.12.2049 | | 82 | 102 | 0,00 |
| Credit Agricole S.A. | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | | 3.000 | 3.318 | 0,11 |
| Credit Suisse AG | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 | | 2.700 | 2.915 | 0,10 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 4.500 | 4.361 | 0,15 |
| Denali Borrower LLC | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2020 | | 2.000 | 2.100 | 0,07 |
| Dexia Credit Local S.A. | | | | |
| 1,875 % fällig am 29.01.2020 | | 19.000 | 18.700 | 0,62 |
| Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. 2012-1 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2022 | | 1.613 | 1.652 | 0,06 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | | | | |
| 6,125 % fällig am 14.05.2017 | £ | 400 | 623 | 0,02 |
| 6,150 % fällig am 01.04.2018 | $ | 1.200 | 1.304 | 0,04 |
| HBOS PLC | | | | |
| 0,687 % fällig am 01.09.2016 | € | 8.800 | 9.574 | 0,32 |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | $ | 2.200 | 2.195 | 0,07 |
| HSBC Bank USA N.A. | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.08.2017 | | 8.600 | 9.150 | 0,30 |
| International Lease Finance Corp. | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.09.2016 | | 6.100 | 6.275 | 0,21 |
| Intesa Sanpaolo SpA | | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | | 1.200 | 1.204 | 0,04 |
| JPMorgan Chase & Co. | | | | |
| 1,027 % fällig am 26.02.2016 | | 14.300 | 14.302 | 0,48 |
| 1,063 % fällig am 30.05.2017 | £ | 100 | 146 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 23.01.2020 | $ | 12.500 | 12.304 | 0,41 |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 2.550 | 2.563 | 0,09 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2016 | | 15.600 | 15.665 | 0,52 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. | | | | |
| 0,832 % fällig am 13.06.2016 | | 200 | 200 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | | 10.700 | 11.443 | 0,38 |
| KBC Bank NV | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 3.000 | 3.278 | 0,11 |
| LBG Capital No.2 PLC | | | | |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | € | 800 | 1.245 | 0,04 |
| 15,000 % fällig am 21.12.2019 | £ | 200 | 401 | 0,01 |
| Lloyds Bank PLC | | | | |
| 12,000 % fällig am 29.12.2049 | $ | 5.700 | 8.133 | 0,27 |
| Lloyds Banking Group PLC | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 30.228 | 46.774 | 1,55 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 300 | 469 | 0,02 |
| Morgan Stanley | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | $ | 3.200 | 3.268 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 900 | 929 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 18.10.2016 | | 2.800 | 2.897 | 0,10 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2018 | | 600 | 658 | 0,02 |
| Murray Street Investment Trust I | | | | |
| 4,647 % fällig am 09.03.2017 | | 1.900 | 1.958 | 0,07 |
| Nationwide Building Society | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.07.2025 | | 1.400 | 1.446 | 0,05 |
| Navient Corp. | | | | |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 5.600 | 5.908 | 0,20 |
| 8,780 % fällig am 15.09.2016 | MXN | 1.500 | 87 | 0,00 |
| Novo Banco S.A. | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.05.2019 | € | 800 | 778 | 0,03 |
| QBE Capital Funding III Ltd. | | | | |
| 7,250 % fällig am 24.05.2041 | $ | 8.800 | 9.724 | 0,32 |
| QNB Finance Ltd. | | | | |
| 3,375 % fällig am 22.02.2017 | | 8.800 | 8.963 | 0,30 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | | | | |
| 6,666 % fällig am 29.04.2049 | CAD | 1.300 | 1.050 | 0,04 |
| 6,990 % fällig am 29.10.2049 | $ | 3.200 | 3.720 | 0,12 |
| Royal Bank of Scotland PLC | | | | |
| 6,934 % fällig am 09.04.2018 | € | 2.000 | 2.436 | 0,08 |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 600 | 651 | 0,02 |
| Santander UK Group Holdings PLC | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | £ | 4.200 | 6.304 | 0,21 |
| State Bank of India | | | | |
| 2,467 % fällig am 21.01.2016 | $ | 6.000 | $ 5.999 | 0,20 |
| UBS AG | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2016 | | 250 | 256 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 | | 12.800 | 14.611 | 0,49 |
| UBS Group AG | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 6.900 | 7.882 | 0,26 |
| 7,125 % fällig am 29.12.2049 | $ | 8.100 | 8.505 | 0,28 |
| Waha Aerospace BV | | | | |
| 3,925 % fällig am 28.07.2020 | | 9.900 | 10.278 | 0,34 |
| Wells Fargo & Co. | | | | |
| 1,200 % fällig am 22.07.2020 | | 1.900 | 1.895 | 0,06 |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | | 2.200 | 2.196 | 0,07 |
| | | | 567.782 | 18,87 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| AbbVie, Inc. | | | | |
| 1,800 % fällig am 14.05.2018 | | 5.400 | 5.378 | 0,18 |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | | 4.400 | 4.360 | 0,15 |
| 3,200 % fällig am 06.11.2022 | | 2.300 | 2.267 | 0,08 |
| Actavis Funding SCS | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | | 500 | 502 | 0,02 |
| 1,850 % fällig am 01.03.2017 | | 7.200 | 7.215 | 0,24 |
| American Airlines 2011-1 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.01.2021 | | 2.379 | 2.525 | 0,08 |
| Anglo American Capital PLC | | | | |
| 1,271 % fällig am 15.04.2016 | | 1.700 | 1.684 | 0,06 |
| Aviation Capital Group Corp. | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.09.2016 | | 14.500 | 14.627 | 0,49 |
| Caesars Entertainment Operating Co., Inc. | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 (a) | | 3.000 | 2.295 | 0,08 |
| CCO Safari II LLC | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 1.000 | 995 | 0,03 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.500 | 1.496 | 0,05 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 6.300 | 6.303 | 0,21 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 700 | 709 | 0,02 |
| 6,484 % fällig am 23.10.2045 | | 1.400 | 1.406 | 0,05 |
| 6,834 % fällig am 23.10.2055 | | 300 | 297 | 0,01 |
| ConAgra Foods, Inc. | | | | |
| 1,900 % fällig am 25.01.2018 | | 7.100 | 7.064 | 0,23 |
| Continental Airlines 2010-1 Class B Pass-Through Trust | | | | |
| 6,000 % fällig am 12.01.2019 | | 479 | 499 | 0,02 |
| CVS Health Corp. | | | | |
| 1,900 % fällig am 20.07.2018 | | 1.900 | 1.900 | 0,06 |
| 2,800 % fällig am 20.07.2020 | | 600 | 603 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.07.2022 | | 200 | 204 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 20.07.2025 | | 2.200 | 2.250 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 20.07.2035 | | 600 | 621 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 20.07.2045 | | 900 | 952 | 0,03 |
| Delta Air Lines 2010-1 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| 6,200 % fällig am 02.07.2018 | | 573 | 615 | 0,02 |
| Delta Air Lines 2010-2 Class A Pass-Through Trust | | | | |
| 4,950 % fällig am 23.05.2019 | | 582 | 612 | 0,02 |
| DISH DBS Corp. | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 3.800 | 4.142 | 0,14 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | |
| 1,500 % fällig am 17.01.2017 | | 11.400 | 11.323 | 0,38 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2016 | | 13.600 | 13.603 | 0,45 |
| 3,984 % fällig am 15.06.2016 | | 11.300 | 11.427 | 0,38 |
| 4,250 % fällig am 03.02.2017 | | 1.500 | 1.533 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2016 | | 11.500 | 12.163 | 0,40 |
| General Motors Financial Co., Inc. | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 24.000 | 24.072 | 0,80 |
| Harvest Operations Corp. | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.05.2018 | | 4.500 | 4.486 | 0,15 |
| Kraft Heinz Foods Co. | | | | |
| 1,600 % fällig am 30.06.2017 | | 800 | 798 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 900 | 896 | 0,03 |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 400 | 399 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 200 | 202 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2025 | | 100 | 101 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2035 | | 100 | 103 | 0,00 |
| 5,200 % fällig am 15.07.2045 | | 400 | 420 | 0,01 |
| Masco Corp. | | | | |
| 5,850 % fällig am 15.03.2017 | | 500 | 522 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 03.10.2016 | | 3.000 | 3.097 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **MCE Finance Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | $ 1.900 | $ 1.739 | 0,06 |
| **Mylan, Inc.** | | | |
| 1,800 % fällig am 24.06.2016 | 4.835 | 4.832 | 0,16 |
| **RCI Banque S.A.** | | | |
| 4,600 % fällig am 12.04.2016 | 4.600 | 4.639 | 0,15 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 12.06.2018 | 400 | 403 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | 300 | 305 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | 200 | 208 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 12.06.2025 | 1.000 | 1.048 | 0,03 |
| **Rohm & Haas Co.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.09.2017 | 87 | 93 | 0,00 |
| **SABMiller Holdings, Inc.** | | | |
| 1,019 % fällig am 01.08.2018 | 16.100 | 15.983 | 0,53 |
| **Schaeffler Holding Finance BV** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2018 (b) | 700 | 723 | 0,02 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | |
| 3,992 % fällig am 16.02.2016 | 800 | 802 | 0,03 |
| 6,421 % fällig am 20.06.2016 | 3.766 | 3.853 | 0,13 |
| **Tesco PLC** | | | |
| 2,700 % fällig am 05.01.2017 | 3.550 | 3.551 | 0,12 |
| **UAL 2009-1 Pass-Through Trust** | | | |
| 10,400 % fällig am 01.11.2016 | 147 | 156 | 0,01 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | |
| 1,450 % fällig am 17.07.2017 | 3.100 | 3.101 | 0,10 |
| 1,900 % fällig am 16.07.2018 | 1.500 | 1.505 | 0,05 |
| **Universal Health Services, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.08.2019 | 9.700 | 9.906 | 0,33 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.09.2022 | 2.260 | 2.350 | 0,08 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 1,450 % fällig am 01.04.2017 | 3.700 | 3.683 | 0,12 |
| | | 215.546 | 7,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **AES Corp.** | | | |
| 3,414 % fällig am 01.06.2019 | 8.200 | 7.544 | 0,25 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | 300 | 298 | 0,01 |
| 2,450 % fällig am 30.06.2020 | 100 | 99 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | 5.400 | 5.278 | 0,18 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | 23.900 | 23.016 | 0,77 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2035 | 100 | 93 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | 100 | 92 | 0,00 |
| **Dominion Resources, Inc.** | | | |
| 1,250 % fällig am 15.03.2017 | 8.400 | 8.350 | 0,28 |
| **Embarq Corp.** | | | |
| 7,995 % fällig am 01.06.2036 | 2.000 | 2.065 | 0,07 |
| **Kinder Morgan Finance Co. LLC** | | | |
| 5,700 % fällig am 05.01.2016 | 1.500 | 1.500 | 0,05 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | 400 | 395 | 0,01 |
| 2,461 % fällig am 15.01.2019 | 2.500 | 1.906 | 0,07 |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | 12.500 | 11.484 | 0,38 |
| 3,406 % fällig am 17.03.2020 | 1.400 | 997 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 06.02.2017 | 1.300 | 1.219 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 20.01.2020 | 7.200 | 5.670 | 0,19 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2018 | 6.550 | 5.846 | 0,20 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | 44.300 | 44.246 | 1,47 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.08.2017 | 4.000 | 3.946 | 0,13 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 3,650 % fällig am 14.09.2018 | 1.800 | 1.883 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 15.09.2020 | 3.400 | 3.657 | 0,12 |
| 5,150 % fällig am 15.09.2023 | 23.000 | 25.325 | 0,84 |
| | | 154.909 | 5,15 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | 938.237 | 31,18 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Franklin, Ohio, Tobacco Settlement Financing Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2030 | 100 | 88 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 01.06.2047 | 1.800 | 1.558 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2047 | 200 | 186 | 0,01 |
| **Kanawha, West Virginia, Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | $ 5.580 | $ 4.838 | 0,16 |
| **Sacramento, California, Build America General Obligation Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.11.2026 | 3.645 | 4.691 | 0,16 |
| | | 11.361 | 0,38 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.03.2034 | 411 | 409 | 0,01 |
| 0,682 % fällig am 25.11.2031 | 45 | 43 | 0,00 |
| 0,702 % fällig am 25.02.2032 | 102 | 99 | 0,00 |
| 0,762 % fällig am 25.11.2032 | 34 | 33 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2037 | 116 | 117 | 0,01 |
| 0,810 % fällig am 18.10.2030 | 15 | 15 | 0,00 |
| 0,822 % fällig am 25.09.2032 | 8 | 8 | 0,00 |
| 0,922 % fällig am 25.03.2017 | 16 | 16 | 0,00 |
| 1,443 % fällig am 01.11.2042 | 106 | 108 | 0,00 |
| 1,954 % fällig am 01.12.2034 | 13 | 14 | 0,00 |
| 2,283 % fällig am 01.02.2035 | 38 | 40 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 01.03.2020 | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2028 | 54 | 58 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2020 | 93 | 96 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.09.2040 | 3.453 | 3.863 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041 | 1.584 | 1.791 | 0,06 |
| 6,290 % fällig am 25.02.2029 | 179 | 190 | 0,01 |
| **Fannie Mae TBA** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.01.2046 | 2.000 | 2.230 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2045 | 2.000 | 2.260 | 0,08 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 2,450 % fällig am 01.09.2027 | 6 | 6 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040 | 2.403 | 2.673 | 0,09 |
| 11,483 % fällig am 15.04.2044 | 1.773 | 1.856 | 0,06 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,625 % fällig am 20.11.2029 | 8 | 9 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 20.09.2031 | 371 | 384 | 0,01 |
| **Ginnie Mae TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | 8.000 | 8.487 | 0,28 |
| | | 24.815 | 0,82 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (c)(d)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 - 15.07.2024 (e)(f) | 55.028 | 52.846 | 1,76 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (e) | 60.651 | 57.948 | 1,93 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 | 46.808 | 45.779 | 1,52 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 16.059 | 14.042 | 0,47 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 38.705 | 43.053 | 1,43 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 - 15.01.2027 (e)(f) | 61.823 | 70.375 | 2,34 |
| **US Treasury Bonds (c)** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | 14.620 | 13.122 | 0,44 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | 59.000 | 57.315 | 1,90 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 - 15.05.2045 | 25.900 | 25.793 | 0,86 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 (g) | 33.400 | 34.144 | 1,13 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 (e) | 9.000 | 8.964 | 0,30 |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 (e)(f) | 5.300 | 5.216 | 0,17 |
| 1,875 % fällig am 30.11.2021 - 31.10.2022 (c)(e)(f) | 179.500 | 178.115 | 5,92 |
| 2,000 % fällig am 31.05.2021 - 15.08.2025 (c)(e)(f)(g) | 371.300 | 370.577 | 12,31 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 (c) | 194.200 | 196.275 | 6,52 |
| | | 1.173.564 | 39,00 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,552 % fällig am 25.02.2037 | 1.352 | 1.298 | 0,04 |
| 0,702 % fällig am 25.04.2036 | 4.500 | 3.973 | 0,13 |
| **ACE Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 (a) | 1.861 | 690 | 0,02 |
| 0,577 % fällig am 25.08.2036 | 10.208 | 8.564 | 0,28 |
| 0,972 % fällig am 25.12.2045 (a) | 1.773 | 1.111 | 0,04 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.08.2036 | $ 6.944 | $ 6.446 | 0,21 |
| 0,682 % fällig am 25.01.2036 | 4.351 | 3.611 | 0,12 |
| 2,666 % fällig am 25.02.2036 (a) | 4.780 | 4.069 | 0,14 |
| 2,752 % fällig am 25.10.2035 (a) | 1.424 | 1.297 | 0,04 |
| 2,788 % fällig am 25.08.2035 | 628 | 616 | 0,02 |
| 2,805 % fällig am 25.01.2036 | 184 | 160 | 0,01 |
| 2,914 % fällig am 25.03.2037 (a) | 43 | 35 | 0,00 |
| **Alternative Loan Trust** | | | |
| 0,361 % fällig am 25.04.2047 | 2.451 | 2.078 | 0,07 |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 (a) | 196 | 191 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.05.2047 | 2.400 | 2.079 | 0,07 |
| 0,592 % fällig am 20.03.2047 | 20.638 | 16.132 | 0,54 |
| 0,597 % fällig am 20.12.2046 (a) | 535 | 399 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.05.2047 | 3.719 | 3.074 | 0,10 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (a) | 79 | 69 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 20.03.2046 | 172 | 130 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 20.05.2046 (a) | 874 | 669 | 0,02 |
| 0,682 % fällig am 20.09.2046 | 669 | 283 | 0,01 |
| 0,733 % fällig am 20.11.2035 | 66 | 54 | 0,00 |
| 0,792 % fällig am 25.02.2037 (a) | 5.493 | 3.078 | 0,10 |
| 0,822 % fällig am 25.05.2036 (a) | 1.619 | 1.260 | 0,04 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2035 (a) | 624 | 478 | 0,02 |
| 0,922 % fällig am 25.12.2035 (a) | 342 | 245 | 0,01 |
| 1,132 % fällig am 25.07.2036 (a) | 1.283 | 814 | 0,03 |
| 1,322 % fällig am 25.12.2036 (a) | 1.380 | 875 | 0,03 |
| 1,722 % fällig am 25.10.2035 (a) | 5.724 | 4.643 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 25.03.2035 | 619 | 619 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (a) | 559 | 513 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | 98 | 89 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2035 | 539 | 532 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 (a) | 2.350 | 2.183 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 (a) | 1.178 | 1.045 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | 1.913 | 1.668 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | 373 | 343 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 (a) | 2.904 | 2.230 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 (a) | 479 | 376 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 785 | 665 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 (a) | 1.434 | 1.129 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | 222 | 174 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | 1.420 | 1.186 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 2.086 | 2.112 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | 945 | 744 | 0,02 |
| **Alternative Loan Trust Resecuritization** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 (a) | 271 | 235 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 1,177 % fällig am 25.11.2046 | 94 | 48 | 0,00 |
| 1,217 % fällig am 25.09.2046 (a) | 632 | 454 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,314 % fällig am 25.10.2034 | 250 | 250 | 0,01 |
| 2,404 % fällig am 25.11.2045 (a) | 670 | 517 | 0,02 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,892 % fällig am 25.10.2035 | 1.070 | 1.046 | 0,03 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 0,921 % fällig am 25.10.2031 | 76 | 69 | 0,00 |
| **Amresco Residential Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,362 % fällig am 25.06.2029 | 7 | 7 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | 2.182 | 798 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | 2.731 | 1.074 | 0,04 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | 2.819 | 2.688 | 0,09 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 0,532 % fällig am 25.01.2037 | 2.291 | 1.412 | 0,05 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2037 | 775 | 482 | 0,02 |
| 1,122 % fällig am 25.06.2034 | 1.970 | 1.849 | 0,06 |
| 1,472 % fällig am 25.03.2034 | 1.311 | 1.056 | 0,04 |
| **Asset-Backed Securities Corporation Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,517 % fällig am 25.02.2035 | 3.494 | 2.860 | 0,10 |
| 1,576 % fällig am 15.08.2033 | 3.640 | 3.478 | 0,12 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.01.2020 | 167 | 171 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 (a) | 1.125 | 963 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 (a) | 1.595 | 1.321 | 0,04 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,377 % fällig am 10.06.2049 | 700 | 728 | 0,02 |
| 5,568 % fällig am 10.04.2049 | 2.582 | 2.659 | 0,09 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Banc of America Funding Ltd.** | | | |
| 0,503 % fällig am 03.10.2039 | $ 2.042 | $ 2.010 | 0,07 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 20.10.2046 (a) | 911 | 687 | 0,02 |
| 0,632 % fällig am 20.06.2047 | 4.505 | 4.341 | 0,14 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2037 | 2.640 | 2.258 | 0,08 |
| 0,822 % fällig am 25.05.2037 (a) | 483 | 357 | 0,01 |
| 2,801 % fällig am 20.02.2036 | 229 | 227 | 0,01 |
| 2,828 % fällig am 20.06.2036 (a) | 69 | 57 | 0,00 |
| 2,873 % fällig am 20.04.2035 (a) | 5.959 | 4.400 | 0,15 |
| 3,004 % fällig am 20.12.2034 (a) | 70 | 38 | 0,00 |
| 3,007 % fällig am 20.01.2047 (a) | 205 | 174 | 0,01 |
| 3,738 % fällig am 20.06.2037 (a) | 404 | 379 | 0,01 |
| 5,079 % fällig am 20.10.2046 (a) | 365 | 296 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | 472 | 408 | 0,01 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 2,496 % fällig am 25.02.2034 | 28 | 27 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 25.02.2035 | 531 | 520 | 0,02 |
| 2,732 % fällig am 25.05.2035 (a) | 2.548 | 2.401 | 0,08 |
| 2,815 % fällig am 25.09.2034 | 623 | 613 | 0,02 |
| 3,550 % fällig am 20.07.2032 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (a) | 1.568 | 1.485 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2033 | 186 | 187 | 0,01 |
| **BCAP LLC** | | | |
| 10,860 % fällig am 26.07.2036 | 855 | 872 | 0,03 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.01.2037 (a) | 8.038 | 6.492 | 0,22 |
| 1,072 % fällig am 25.09.2047 | 4.712 | 4.055 | 0,13 |
| 2,287 % fällig am 27.11.2036 | 11.046 | 10.961 | 0,36 |
| 5,250 % fällig am 26.02.2036 | 1.927 | 1.721 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2036 | 30.890 | 25.453 | 0,85 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | 3.448 | 3.181 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2037 | 870 | 876 | 0,03 |
| 5,283 % fällig am 26.03.2037 | 3.285 | 974 | 0,03 |
| 16,611 % fällig am 26.04.2037 | 776 | 170 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,285 % fällig am 25.04.2033 | 38 | 38 | 0,00 |
| 2,581 % fällig am 25.02.2033 | 5 | 4 | 0,00 |
| 2,652 % fällig am 25.08.2035 | 406 | 350 | 0,01 |
| 2,802 % fällig am 25.05.2047 (a) | 825 | 744 | 0,02 |
| 2,842 % fällig am 25.01.2035 | 168 | 168 | 0,01 |
| 2,920 % fällig am 25.09.2034 | 560 | 543 | 0,02 |
| 2,928 % fällig am 25.07.2034 | 208 | 202 | 0,01 |
| 2,983 % fällig am 25.01.2035 | 225 | 222 | 0,01 |
| 3,226 % fällig am 25.11.2034 | 18 | 18 | 0,00 |
| 3,266 % fällig am 25.11.2034 | 104 | 103 | 0,00 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.08.2036 (a) | 622 | 480 | 0,02 |
| 0,862 % fällig am 25.04.2036 (a) | 2.094 | 1.653 | 0,06 |
| 0,902 % fällig am 25.02.2036 | 1.327 | 1.098 | 0,04 |
| 1,122 % fällig am 25.09.2034 | 345 | 337 | 0,01 |
| 2,550 % fällig am 25.04.2035 | 174 | 135 | 0,00 |
| 2,577 % fällig am 25.02.2036 (a) | 1.055 | 773 | 0,03 |
| 2,583 % fällig am 25.03.2036 (a) | 1.049 | 779 | 0,03 |
| 2,601 % fällig am 25.05.2035 | 1.776 | 1.758 | 0,06 |
| 2,728 % fällig am 25.01.2034 | 175 | 174 | 0,01 |
| 2,760 % fällig am 25.11.2036 | 371 | 284 | 0,01 |
| 4,193 % fällig am 25.11.2036 (a) | 59 | 43 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities I Trust** | | | |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | 1.474 | 1.410 | 0,05 |
| 0,602 % fällig am 25.06.2047 | 1.686 | 1.640 | 0,05 |
| 0,622 % fällig am 25.12.2036 | 2.185 | 2.002 | 0,07 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2047 | 200 | 172 | 0,01 |
| 0,852 % fällig am 25.11.2035 (a) | 1.500 | 1.467 | 0,05 |
| 0,922 % fällig am 25.12.2035 | 6.700 | 6.157 | 0,20 |
| 1,072 % fällig am 25.08.2035 | 5.346 | 5.085 | 0,17 |
| 1,122 % fällig am 25.11.2035 (a) | 2.680 | 2.317 | 0,08 |
| 1,422 % fällig am 25.10.2037 | 2.127 | 1.979 | 0,07 |
| 1,672 % fällig am 25.08.2037 | 1.875 | 1.725 | 0,06 |
| 2,934 % fällig am 25.07.2036 | 562 | 533 | 0,02 |
| 2,996 % fällig am 25.06.2043 | 162 | 155 | 0,01 |
| 3,041 % fällig am 25.10.2036 | 452 | 438 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2036 | 259 | 259 | 0,01 |
| **Berica 8 Residential MBS Srl** | | | |
| 0,229 % fällig am 31.03.2048 | € 39.748 | 42.379 | 1,41 |
| **Berica ABS Srl** | | | |
| 0,168 % fällig am 31.12.2055 | 8.711 | 9.376 | 0,31 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.10.2036 | $ 11.500 | 7.665 | 0,25 |
| 0,662 % fällig am 25.06.2036 | 1.500 | 1.017 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.10.2036 | 2.141 | 1.273 | 0,04 |
| 0,882 % fällig am 25.06.2035 | $ 1.000 | $ 972 | 0,03 |
| 1,322 % fällig am 25.05.2034 | 1.086 | 1.015 | 0,03 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,042 % fällig am 25.09.2034 | 849 | 773 | 0,03 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 2,702 % fällig am 25.02.2037 | 142 | 144 | 0,00 |
| 4,840 % fällig am 25.03.2037 (a) | 1.968 | 1.842 | 0,06 |
| **Chaseflex Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.07.2037 | 32 | 26 | 0,00 |
| 4,507 % fällig am 25.08.2037 (a) | 1.067 | 901 | 0,03 |
| **ChaseFlex Trust** | | | |
| 4,507 % fällig am 25.08.2037 (a) | 1.336 | 1.128 | 0,04 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | 240 | 251 | 0,01 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities VII, Inc.** | | | |
| 0,922 % fällig am 25.05.2032 | 81 | 78 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,562 % fällig am 25.08.2036 | 3.073 | 2.883 | 0,10 |
| 0,562 % fällig am 25.05.2037 | 1.040 | 1.028 | 0,03 |
| 0,582 % fällig am 25.12.2036 | 546 | 336 | 0,01 |
| 0,592 % fällig am 25.07.2045 | 3.878 | 2.721 | 0,09 |
| 0,621 % fällig am 25.11.2046 | 487 | 412 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.05.2037 | 11.521 | 8.362 | 0,28 |
| 0,662 % fällig am 25.11.2036 | 510 | 461 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2036 | 6.350 | 4.721 | 0,16 |
| 0,682 % fällig am 25.09.2036 | 1.588 | 1.006 | 0,03 |
| 0,802 % fällig am 25.12.2033 | 72 | 70 | 0,00 |
| 1,002 % fällig am 25.07.2035 | 3.174 | 2.834 | 0,09 |
| 1,142 % fällig am 25.09.2035 (a) | 1.500 | 1.427 | 0,05 |
| 2,070 % fällig am 25.09.2035 | 19 | 18 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.02.2034 | 234 | 232 | 0,01 |
| 2,740 % fällig am 25.11.2035 | 1.463 | 1.402 | 0,05 |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 | 9.865 | 9.916 | 0,33 |
| 2,797 % fällig am 25.07.2037 (a) | 53 | 50 | 0,00 |
| 5,487 % fällig am 25.09.2037 (a) | 1.570 | 1.354 | 0,05 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 (a) | 3.574 | 3.280 | 0,11 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | 1.504 | 1.371 | 0,05 |
| 0,572 % fällig am 25.12.2046 | 4.024 | 3.846 | 0,13 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2047 (a) | 498 | 447 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.01.2034 | 4.563 | 4.287 | 0,14 |
| 0,622 % fällig am 25.06.2047 | 4.188 | 3.057 | 0,10 |
| 0,642 % fällig am 25.09.2047 | 11.000 | 8.511 | 0,28 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2036 | 579 | 577 | 0,02 |
| 0,712 % fällig am 25.06.2036 | 2.200 | 1.976 | 0,07 |
| 0,712 % fällig am 25.08.2036 | 2.000 | 1.802 | 0,06 |
| 0,762 % fällig am 25.12.2036 (a) | 264 | 185 | 0,01 |
| 0,782 % fällig am 25.02.2036 | 2.068 | 1.953 | 0,07 |
| 2,147 % fällig am 25.05.2035 | 3.000 | 2.476 | 0,08 |
| 2,822 % fällig am 25.01.2034 (a) | 1.545 | 1.118 | 0,04 |
| 4,399 % fällig am 25.04.2036 | 1.114 | 1.126 | 0,04 |
| 4,874 % fällig am 25.04.2036 | 655 | 587 | 0,02 |
| 4,942 % fällig am 25.07.2036 | 3.900 | 3.160 | 0,11 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2037 | 4.969 | 4.801 | 0,16 |
| 0,572 % fällig am 25.10.2046 (a) | 2.247 | 2.306 | 0,08 |
| 0,582 % fällig am 25.03.2037 | 5.336 | 4.947 | 0,16 |
| 0,772 % fällig am 25.05.2036 | 66 | 64 | 0,00 |
| 0,872 % fällig am 25.04.2036 | 4.600 | 4.071 | 0,14 |
| 1,062 % fällig am 25.10.2035 | 2.200 | 1.923 | 0,06 |
| 4,994 % fällig am 25.05.2035 | 1.623 | 1.627 | 0,05 |
| 5,111 % fällig am 25.08.2035 | 1.400 | 1.380 | 0,05 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,652 % fällig am 25.05.2035 | 121 | 104 | 0,00 |
| 0,712 % fällig am 25.04.2035 | 195 | 167 | 0,01 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | 1.123 | 862 | 0,03 |
| 1,082 % fällig am 25.02.2035 | 10 | 9 | 0,00 |
| 1,162 % fällig am 25.02.2035 | 3.416 | 2.883 | 0,10 |
| 2,390 % fällig am 25.04.2035 | 103 | 86 | 0,00 |
| 2,391 % fällig am 20.07.2034 | 732 | 729 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 20.04.2036 (a) | 215 | 185 | 0,01 |
| 2,593 % fällig am 20.02.2036 (a) | 218 | 204 | 0,01 |
| 2,606 % fällig am 20.05.2036 (a) | 2.637 | 2.381 | 0,08 |
| 2,629 % fällig am 20.02.2036 | 3.109 | 2.681 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 25.12.2027 (a) | 108 | 104 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2035 | 553 | 564 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 (a) | 16 | 15 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2037 (a) | 83 | 80 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 (a) | 255 | 248 | 0,01 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,297 % fällig am 15.12.2039 | $ 11.760 | $ 12.030 | 0,40 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 0,265 % fällig am 15.05.2023 (h) | 40.000 | 419 | 0,01 |
| 0,824 % fällig am 25.03.2032 | 85 | 79 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.01.2032 | 8 | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 (a) | 1.185 | 926 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital** | | | |
| 5,383 % fällig am 15.02.2040 | 345 | 349 | 0,01 |
| 5,467 % fällig am 16.09.2039 | 353 | 355 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.09.2037 | 2.597 | 2.334 | 0,08 |
| 2,577 % fällig am 26.02.2036 | 636 | 616 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust (a)** | | | |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | 190 | 166 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 | 685 | 518 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 0,428 % fällig am 27.02.2036 | 589 | 564 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.07.2037 | 607 | 398 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,971 % fällig am 25.03.2037 (a) | 17.710 | 9.120 | 0,30 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.01.2037 (a) | 205 | 93 | 0,00 |
| 0,672 % fällig am 25.07.2036 | 2.900 | 2.093 | 0,07 |
| 4,002 % fällig am 25.01.2037 (a) | 211 | 113 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,720 % fällig am 25.09.2036 | 8.503 | 5.730 | 0,19 |
| **DECO 12-UK 4 PLC** | | | |
| 0,739 % fällig am 27.01.2020 | £ 1.026 | 1.461 | 0,05 |
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | |
| 1,151 % fällig am 15.09.2029 | $ 9 | 9 | 0,00 |
| 7,310 % fällig am 15.12.2029 | 6 | 6 | 0,00 |
| **Deutsche Alternative-A Securities Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,722 % fällig am 25.09.2047 (a) | 2.644 | 2.062 | 0,07 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,961 % fällig am 25.05.2040 | 241 | 220 | 0,01 |
| **EMF-NL BV** | | | |
| 0,948 % fällig am 17.07.2041 | € 100 | 94 | 0,00 |
| **EMF-NL Prime** | | | |
| 0,748 % fällig am 17.04.2041 | 497 | 503 | 0,02 |
| **Eurosail-NL BV** | | | |
| 1,448 % fällig am 17.10.2040 | 253 | 273 | 0,01 |
| **FHLMC Multifamily Structured Pass-Through Certificates** | | | |
| 1,553 % fällig am 25.10.2021 (h) | $ 13.774 | 1.013 | 0,03 |
| **FHLMC Multifamily VRD Certificates** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.08.2051 | 16.600 | 16.973 | 0,56 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | |
| 0,702 % fällig am 25.09.2031 | 346 | 342 | 0,01 |
| 1,643 % fällig am 25.07.2044 | 1.705 | 1.734 | 0,06 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 0,582 % fällig am 25.11.2036 | 2.306 | 1.283 | 0,04 |
| **First Alliance Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 20.12.2027 | 17 | 16 | 0,00 |
| **First Frankin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 1,022 % fällig am 25.07.2035 | 3.000 | 2.246 | 0,07 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | 4.021 | 3.774 | 0,13 |
| 0,782 % fällig am 25.11.2035 | 3.048 | 2.204 | 0,07 |
| 0,902 % fällig am 25.12.2035 | 1.061 | 1.009 | 0,03 |
| 0,932 % fällig am 25.09.2035 | 350 | 350 | 0,01 |
| 0,952 % fällig am 25.09.2035 | 1.500 | 1.424 | 0,05 |
| 1,232 % fällig am 25.04.2035 | 1.737 | 1.648 | 0,05 |
| 1,307 % fällig am 25.03.2035 | 1.700 | 1.579 | 0,05 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,204 % fällig am 25.09.2034 | 609 | 598 | 0,02 |
| 2,369 % fällig am 25.01.2036 (a) | 1.666 | 1.344 | 0,04 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (a) | 886 | 785 | 0,03 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,723 % fällig am 25.08.2035 | 164 | 147 | 0,00 |
| 2,949 % fällig am 25.05.2035 | 121 | 110 | 0,00 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 0,602 % fällig am 25.08.2037 | 13.889 | 7.241 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **First Republic Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,681 % fällig am 15.11.2031 | $ | 114 | $ 110 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.11.2036 | | 3.296 | 1.490 | 0,05 |
| 0,592 % fällig am 25.02.2037 | | 3.219 | 1.826 | 0,06 |
| 0,672 % fällig am 25.05.2036 | | 1.845 | 1.106 | 0,04 |
| 0,832 % fällig am 25.11.2035 | | 14.388 | 10.670 | 0,35 |
| 0,912 % fällig am 25.07.2035 | | 2.800 | 2.491 | 0,08 |
| 1,172 % fällig am 25.02.2034 | | 1.297 | 1.243 | 0,04 |
| **GE Commercial Mortgage Corporation Trust** | | | | |
| 5,483 % fällig am 10.12.2049 | | 10.896 | 11.292 | 0,38 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 19.04.2036 (a) | | 190 | 173 | 0,01 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 2,029 % fällig am 24.04.2047 | £ | 16.833 | 24.878 | 0,83 |
| **Great Hall Mortgages No.1 PLC** | | | | |
| 0,663 % fällig am 18.06.2039 | $ | 249 | 235 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,692 % fällig am 25.11.2045 | | 555 | 484 | 0,02 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 0,872 % fällig am 25.08.2037 | | 1.085 | 989 | 0,03 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 0,622 % fällig am 25.11.2036 | | 5.777 | 3.285 | 0,11 |
| 0,692 % fällig am 25.04.2036 | | 911 | 562 | 0,02 |
| **GSMS Trust** | | | | |
| 5,374 % fällig am 17.05.2045 | | 333 | 333 | 0,01 |
| **GSMSC Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.10.2035 | | 3.652 | 3.253 | 0,11 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,699 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 267 | 223 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 46 | 42 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | | 90 | 87 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 2.222 | 1.885 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 174 | 167 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 629 | 590 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 176 | 151 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,453 % fällig am 19.01.2036 | | 2.113 | 1.440 | 0,05 |
| 0,582 % fällig am 25.05.2038 | | 2.234 | 1.615 | 0,05 |
| 0,622 % fällig am 19.05.2035 | | 134 | 112 | 0,00 |
| 0,682 % fällig am 19.02.2036 | | 660 | 492 | 0,02 |
| 1,222 % fällig am 19.11.2034 | | 394 | 314 | 0,01 |
| 2,501 % fällig am 19.06.2045 (a) | | 1.919 | 1.211 | 0,04 |
| 2,618 % fällig am 19.10.2033 | | 155 | 155 | 0,01 |
| **Heloc Summit Pels Trust** | | | | |
| 0,717 % fällig am 12.08.2047 | | 353 | 328 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 0,607 % fällig am 25.07.2037 | | 1.512 | 1.441 | 0,05 |
| 1,517 % fällig am 25.05.2035 | | 500 | 440 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.07.2037 | | 1.249 | 788 | 0,03 |
| 0,662 % fällig am 25.04.2037 | | 1.647 | 1.018 | 0,03 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,296 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 7.404 | 4.646 | 0,15 |
| **HSI Asset Securitization Corporation Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.12.2036 | | 2.413 | 1.028 | 0,03 |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | | 200 | 138 | 0,00 |
| 0,612 % fällig am 25.01.2037 | | 1.500 | 911 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.12.2036 | | 4.516 | 1.950 | 0,06 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 1,062 % fällig am 25.09.2034 | | 38 | 36 | 0,00 |
| 1,082 % fällig am 25.03.2035 | | 2.239 | 2.092 | 0,07 |
| 1,202 % fällig am 25.10.2034 | | 2.692 | 2.544 | 0,08 |
| 1,342 % fällig am 25.11.2034 | | 104 | 97 | 0,00 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 1,842 % fällig am 25.01.2032 | | 32 | 30 | 0,00 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust (a)** | | | | |
| 2,899 % fällig am 25.06.2037 | | 167 | 124 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 | | 4.314 | 2.777 | 0,09 |
| **IndyMac INDX Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.07.2036 | | 3.506 | 2.823 | 0,09 |
| 0,722 % fällig am 25.07.2035 | | 649 | 563 | 0,02 |
| 1,222 % fällig am 25.11.2034 | | 302 | 275 | 0,01 |
| 1,242 % fällig am 25.11.2034 (a) | | 233 | 192 | 0,01 |
| 2,389 % fällig am 25.06.2037 | | 2.023 | 1.145 | 0,04 |
| 2,578 % fällig am 25.07.2037 | | 4.699 | 3.217 | 0,11 |
| 2,656 % fällig am 25.10.2034 | | 797 | 768 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 25.06.2036 | | 797 | 654 | 0,02 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 0,652 % fällig am 25.01.2037 | $ | 393 | $ 197 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | | 334 | 334 | 0,01 |
| 0,582 % fällig am 25.09.2036 | | 6.286 | 5.772 | 0,19 |
| 1,799 % fällig am 26.05.2037 | | 4.139 | 3.720 | 0,12 |
| 2,749 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 859 | 679 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,397 % fällig am 15.05.2045 | | 5.414 | 5.471 | 0,18 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 0,712 % fällig am 25.05.2035 | | 1.000 | 922 | 0,03 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | | 1.198 | 630 | 0,02 |
| 0,692 % fällig am 25.05.2036 | | 7.500 | 6.331 | 0,21 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | | 3.900 | 2.764 | 0,09 |
| 3,422 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 4.806 | 3.302 | 0,11 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 2,048 % fällig am 27.07.2037 | | 535 | 500 | 0,02 |
| 2,429 % fällig am 25.12.2034 | | 173 | 174 | 0,01 |
| 2,607 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 655 | 593 | 0,02 |
| 2,636 % fällig am 25.11.2035 | | 121 | 115 | 0,00 |
| 2,765 % fällig am 25.05.2034 | | 33 | 33 | 0,00 |
| 4,388 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 48 | 44 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 138 | 121 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 (a) | | 668 | 592 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 291 | 246 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 717 | 615 | 0,02 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,923 % fällig am 27.09.2036 | | 380 | 380 | 0,01 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,342 % fällig am 15.09.2039 | | 1.465 | 1.491 | 0,05 |
| **Leek Finance Number Eighteen PLC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 21.09.2038 | | 213 | 225 | 0,01 |
| **Leek Finance Number Seventeen PLC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 21.12.2037 | | 162 | 174 | 0,01 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 5,945 % fällig am 25.04.2036 | | 3.401 | 3.063 | 0,10 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 1,121 % fällig am 25.08.2047 | | 1.994 | 1.359 | 0,05 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,532 % fällig am 25.11.2036 | | 17.560 | 7.349 | 0,24 |
| 0,722 % fällig am 25.02.2036 | | 481 | 273 | 0,01 |
| 0,762 % fällig am 25.01.2046 | | 5.000 | 4.098 | 0,14 |
| 0,802 % fällig am 25.08.2045 | | 3.172 | 2.960 | 0,10 |
| 1,217 % fällig am 25.02.2035 | | 845 | 842 | 0,03 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 0,401 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 135 | 112 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,324 % fällig am 25.05.2034 | | 274 | 273 | 0,01 |
| 2,611 % fällig am 25.07.2035 (a) | | 1.178 | 1.027 | 0,03 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.10.2036 | | 2.949 | 2.555 | 0,09 |
| **MASTR Seasoned Securitization Trust** | | | | |
| 3,450 % fällig am 25.10.2032 | | 358 | 352 | 0,01 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.05.2037 | | 216 | 169 | 0,01 |
| 0,792 % fällig am 25.01.2037 | | 2.429 | 1.597 | 0,05 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 1,031 % fällig am 15.11.2031 | | 119 | 112 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corporation Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,771 % fällig am 15.12.2030 | | 1.252 | 1.203 | 0,04 |
| **MERIT Securities Corp.** | | | | |
| 6,690 % fällig am 28.07.2033 | | 53 | 53 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.04.2037 | | 5.973 | 5.600 | 0,19 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,492 % fällig am 25.04.2047 | | 1.214 | 688 | 0,02 |
| 0,592 % fällig am 25.07.2037 | | 1.909 | 1.018 | 0,03 |
| 0,662 % fällig am 25.08.2037 | | 26.139 | 16.174 | 0,54 |
| 0,672 % fällig am 25.11.2035 | | 492 | 466 | 0,02 |
| 0,682 % fällig am 25.03.2037 | | 7.500 | 4.916 | 0,16 |
| 0,682 % fällig am 25.04.2037 | | 2.784 | 1.454 | 0,05 |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | | 2.434 | 1.721 | 0,06 |
| 0,732 % fällig am 25.12.2036 | | 8.554 | 8.033 | 0,27 |
| 0,742 % fällig am 25.03.2037 | | 1.700 | 1.118 | 0,04 |
| 0,812 % fällig am 25.12.2036 | | 2.000 | 1.678 | 0,06 |
| 0,902 % fällig am 25.05.2036 | $ | 1.503 | $ 1.384 | 0,05 |
| 1,244 % fällig am 25.10.2035 | | 143 | 137 | 0,00 |
| 2,496 % fällig am 25.02.2035 | | 69 | 68 | 0,00 |
| 2,658 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 1.253 | 846 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Asset-Backed Securities Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 1,202 % fällig am 25.01.2035 | | 4.000 | 3.144 | 0,10 |
| 0,482 % fällig am 25.12.2036 | | 2.353 | 1.390 | 0,05 |
| 0,552 % fällig am 25.10.2036 | | 1.526 | 1.179 | 0,04 |
| 0,562 % fällig am 25.10.2036 | | 43 | 24 | 0,00 |
| 0,562 % fällig am 25.11.2036 | | 1.203 | 750 | 0,03 |
| 0,572 % fällig am 25.06.2036 | | 153 | 132 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.09.2036 | | 92 | 42 | 0,00 |
| 0,572 % fällig am 25.10.2036 | | 12.693 | 7.899 | 0,26 |
| 0,572 % fällig am 25.11.2036 | | 2.380 | 1.428 | 0,05 |
| 0,572 % fällig am 25.12.2036 | | 403 | 241 | 0,01 |
| 0,602 % fällig am 25.03.2037 | | 1.699 | 878 | 0,03 |
| 0,642 % fällig am 25.10.2036 | | 1.737 | 983 | 0,03 |
| 0,672 % fällig am 25.03.2037 | | 850 | 443 | 0,01 |
| 1,187 % fällig am 25.07.2035 | | 2.100 | 2.004 | 0,07 |
| 1,367 % fällig am 25.06.2034 | | 1.854 | 1.757 | 0,06 |
| 1,472 % fällig am 25.09.2033 | | 233 | 223 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | | |
| 5,665 % fällig am 15.04.2049 | | 38.592 | 40.060 | 1,33 |
| **Morgan Stanley Capital I, Inc. Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 25.03.2036 | | 7.531 | 6.888 | 0,23 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,146 % fällig am 25.11.2037 | | 1.745 | 1.344 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 25.09.2022 (a) | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 26.09.2036 | | 6.768 | 6.807 | 0,23 |
| 5,794 % fällig am 15.08.2045 | | 1.965 | 2.018 | 0,07 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | | |
| 0,502 % fällig am 25.06.2037 | | 907 | 903 | 0,03 |
| **Mortgages No.7 PLC** | | | | |
| 1,040 % fällig am 31.10.2038 | £ | 1.265 | 1.773 | 0,06 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,702 % fällig am 25.10.2035 | $ | 234 | 234 | 0,01 |
| 1,142 % fällig am 25.03.2035 | | 1.532 | 1.341 | 0,04 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,472 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.871 | 1.884 | 0,06 |
| **Nomura Asset Acceptance Corporation Alternative Loan Trust** | | | | |
| 1,291 % fällig am 25.02.2035 | $ | 2.179 | 1.920 | 0,06 |
| 2,716 % fällig am 25.10.2035 | | 491 | 462 | 0,02 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,752 % fällig am 25.10.2036 (a) | | 2.909 | 1.215 | 0,04 |
| 0,912 % fällig am 25.05.2035 | | 2.083 | 1.998 | 0,07 |
| 1,012 % fällig am 25.09.2035 | | 1.300 | 1.166 | 0,04 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,844 % fällig am 26.12.2046 | | 4.828 | 4.401 | 0,15 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.11.2036 | | 3.856 | 1.837 | 0,06 |
| 0,632 % fällig am 25.01.2037 | | 1.998 | 921 | 0,03 |
| 2,297 % fällig am 25.03.2035 | | 1.700 | 1.517 | 0,05 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corporation Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 5,675 % fällig am 25.12.2035 | | 134 | 139 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,562 % fällig am 25.01.2037 | | 1.509 | 874 | 0,03 |
| 0,912 % fällig am 25.08.2035 | | 1.700 | 1.437 | 0,05 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.05.2037 | | 1.311 | 922 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 0,892 % fällig am 25.09.2035 | | 17.125 | 15.428 | 0,51 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 0,902 % fällig am 25.08.2035 | | 3.400 | 3.196 | 0,11 |
| 0,922 % fällig am 25.07.2035 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 1,367 % fällig am 25.06.2035 | | 4.800 | 4.210 | 0,14 |
| 1,742 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 2.000 | 1.484 | 0,05 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | | |
| 1,367 % fällig am 25.05.2035 (a) | | 3.000 | 2.209 | 0,07 |
| 1,772 % fällig am 25.01.2035 | | 2.000 | 1.698 | 0,06 |
| **Popular Asset-Backed Securities Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.01.2037 | | 2.867 | 2.383 | 0,08 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.07.2034 | | 1.197 | 1.161 | 0,04 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **RAAC Trust** | | | | |
| 0,722 % fällig am 25.06.2044 | $ | 500 | $ 429 | 0,01 |
| 0,992 % fällig am 25.03.2037 | | 1.700 | 1.470 | 0,05 |
| 1,385 % fällig am 25.10.2045 | | 3.200 | 2.923 | 0,10 |
| **RBSCF Trust** | | | | |
| 5,952 % fällig am 16.02.2051 | | 459 | 466 | 0,02 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 0,461 % fällig am 27.06.2036 | | 8.046 | 2.105 | 0,07 |
| 0,471 % fällig am 26.02.2037 | | 4.317 | 4.083 | 0,14 |
| 9,391 % fällig am 26.06.2037 | | 1.829 | 1.080 | 0,04 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 0,922 % fällig am 25.12.2033 | | 123 | 115 | 0,00 |
| 1,122 % fällig am 25.08.2032 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 4,341 % fällig am 25.09.2037 | | 46 | 38 | 0,00 |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037 | | 3.855 | 2.080 | 0,07 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 | | 99 | 102 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.02.2047 | | 6.577 | 3.599 | 0,12 |
| 0,612 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 3.080 | 2.388 | 0,08 |
| 0,612 % fällig am 25.12.2036 | | 1.427 | 1.210 | 0,04 |
| 0,672 % fällig am 25.08.2037 | | 415 | 328 | 0,01 |
| 0,702 % fällig am 25.12.2045 | | 207 | 148 | 0,01 |
| 0,722 % fällig am 25.08.2035 | | 103 | 80 | 0,00 |
| 0,822 % fällig am 25.11.2036 (a) | | 416 | 259 | 0,01 |
| 1,757 % fällig am 25.08.2035 | | 193 | 165 | 0,01 |
| 3,652 % fällig am 25.12.2035 (a) | | 586 | 509 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 1.179 | 973 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 (a) | | 368 | 284 | 0,01 |
| **Residential Accredit Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.07.2036 | | 8.303 | 7.383 | 0,25 |
| 0,572 % fällig am 25.08.2036 | | 566 | 549 | 0,02 |
| 0,672 % fällig am 25.04.2037 | | 14.000 | 12.923 | 0,43 |
| 0,682 % fällig am 25.07.2036 | | 1.300 | 786 | 0,03 |
| 0,692 % fällig am 25.07.2036 | | 1.500 | 948 | 0,03 |
| 0,862 % fällig am 25.01.2036 | | 3.473 | 3.315 | 0,11 |
| 1,247 % fällig am 25.07.2034 | | 1.244 | 1.117 | 0,04 |
| 5,510 % fällig am 25.04.2033 | | 1.185 | 1.247 | 0,04 |
| 6,228 % fällig am 25.04.2032 | | 25 | 25 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 0,582 % fällig am 25.02.2037 | | 5.557 | 5.112 | 0,17 |
| 0,722 % fällig am 25.03.2036 | | 1.200 | 1.056 | 0,04 |
| 0,792 % fällig am 25.05.2037 | | 9.209 | 5.496 | 0,18 |
| 0,982 % fällig am 25.06.2032 | | 6 | 5 | 0,00 |
| 1,042 % fällig am 25.05.2035 | | 3.000 | 2.718 | 0,09 |
| **Residential Asset Securitization Trust (a)** | | | | |
| 1,122 % fällig am 25.10.2035 | | 954 | 718 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 35 | 31 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 163 | 147 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 273 | 220 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 577 | 414 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 | | 448 | 425 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities I Trust** | | | | |
| 3,151 % fällig am 25.04.2037 (a) | | 158 | 139 | 0,00 |
| 3,876 % fällig am 27.07.2037 (a) | | 1.084 | 891 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 1.654 | 1.561 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | | 80 | 84 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Securities 25 PLC** | | | | |
| 3,082 % fällig am 16.12.2050 | £ | 299 | 450 | 0,02 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.10.2046 | $ | 1.680 | 1.386 | 0,05 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 1,187 % fällig am 25.02.2034 | | 997 | 933 | 0,03 |
| 1,382 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 1.229 | 1.022 | 0,03 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 0,632 % fällig am 25.10.2036 | | 2.100 | 1.225 | 0,04 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 0,482 % fällig am 25.11.2036 | | 375 | 140 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 25.06.2037 | | 6.154 | 3.810 | 0,13 |
| 0,662 % fällig am 25.07.2036 | | 3.200 | 1.958 | 0,07 |
| 0,682 % fällig am 25.02.2037 | | 1.676 | 727 | 0,02 |
| 0,702 % fällig am 25.10.2036 | | 1.027 | 884 | 0,03 |
| 0,702 % fällig am 25.06.2037 | | 8.879 | 5.548 | 0,18 |
| 0,772 % fällig am 25.03.2036 | | 2.600 | 2.075 | 0,07 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.09.2037 | | 726 | 328 | 0,01 |
| 1,247 % fällig am 25.05.2035 | | 850 | 800 | 0,03 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 2.393 | 1.237 | 0,04 |
| **Storm BV** | | | | |
| 0,658 % fällig am 22.08.2054 | € | 6.374 | 6.938 | 0,23 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 1,744 % fällig am 25.03.2037 | $ | 1.849 | $ 1.435 | 0,05 |
| 2,516 % fällig am 25.12.2034 | | 122 | 120 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 846 | 759 | 0,03 |
| 2,579 % fällig am 25.09.2035 | | 858 | 769 | 0,03 |
| 2,580 % fällig am 25.04.2034 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,632 % fällig am 25.09.2034 | | 1.992 | 1.988 | 0,07 |
| 4,456 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 450 | 336 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 0,782 % fällig am 25.10.2035 | | 4.836 | 4.762 | 0,16 |
| 1,112 % fällig am 25.06.2035 | | 3.100 | 3.046 | 0,10 |
| 1,142 % fällig am 25.05.2035 | | 7.800 | 7.346 | 0,24 |
| 1,157 % fällig am 25.08.2035 | | 2.500 | 2.422 | 0,08 |
| 1,322 % fällig am 25.01.2035 | | 1.779 | 1.759 | 0,06 |
| 1,352 % fällig am 25.01.2035 | | 4.800 | 4.200 | 0,14 |
| 1,397 % fällig am 25.01.2035 | | 955 | 686 | 0,02 |
| 1,547 % fällig am 25.01.2035 | | 418 | 103 | 0,00 |
| 1,997 % fällig am 25.01.2035 | | 456 | 66 | 0,00 |
| 2,147 % fällig am 25.01.2035 (a) | | 532 | 26 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 | | 2.445 | 1.860 | 0,06 |
| 0,612 % fällig am 25.06.2036 | | 436 | 365 | 0,01 |
| 0,622 % fällig am 25.10.2036 | | 6.927 | 5.589 | 0,19 |
| 0,632 % fällig am 25.08.2036 (a) | | 244 | 188 | 0,01 |
| 0,652 % fällig am 19.07.2035 | | 668 | 638 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 1,082 % fällig am 25.02.2035 | | 267 | 234 | 0,01 |
| 2,586 % fällig am 25.12.2033 | | 349 | 345 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,592 % fällig am 25.12.2036 | | 2.312 | 2.053 | 0,07 |
| 0,602 % fällig am 25.01.2037 | | 1.323 | 663 | 0,02 |
| 0,742 % fällig am 25.05.2037 | | 66 | 60 | 0,00 |
| 0,872 % fällig am 25.11.2035 | | 3.700 | 3.356 | 0,11 |
| 0,922 % fällig am 25.11.2037 | | 6.300 | 5.111 | 0,17 |
| 1,092 % fällig am 25.11.2035 | | 8.000 | 6.001 | 0,20 |
| 1,744 % fällig am 25.04.2035 | | 438 | 420 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corporation Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,339 % fällig am 25.01.2032 | | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,428 % fällig am 25.08.2032 | | 17 | 17 | 0,00 |
| 2,488 % fällig am 25.06.2033 | | 18 | 18 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corporation Trust** | | | | |
| 0,882 % fällig am 25.09.2035 | | 16.000 | 12.172 | 0,40 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 1,102 % fällig am 25.04.2043 | | 697 | 684 | 0,02 |
| 1,672 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 4.068 | 3.578 | 0,12 |
| 2,394 % fällig am 25.06.2037 | | 9.255 | 8.880 | 0,30 |
| **UBS-Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,432 % fällig am 10.01.2045 (h) | | 9.410 | 733 | 0,02 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,749 % fällig am 15.07.2045 | | 18.064 | 18.222 | 0,61 |
| 5,952 % fällig am 15.02.2051 | | 8.363 | 8.768 | 0,29 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | | |
| 2,707 % fällig am 20.08.2035 (a) | | 1.023 | 975 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 25.11.2045 | | 3.488 | 3.290 | 0,11 |
| 0,712 % fällig am 25.07.2045 | | 467 | 442 | 0,01 |
| 0,987 % fällig am 25.01.2047 | | 685 | 624 | 0,02 |
| 0,997 % fällig am 25.01.2047 (a) | | 242 | 197 | 0,01 |
| 1,007 % fällig am 25.06.2047 (a) | | 30 | 11 | 0,00 |
| 1,017 % fällig am 25.04.2047 | | 4.608 | 3.905 | 0,13 |
| 1,053 % fällig am 25.12.2046 | | 451 | 412 | 0,01 |
| 1,237 % fällig am 25.06.2046 | | 532 | 499 | 0,02 |
| 1,257 % fällig am 25.08.2046 | | 600 | 502 | 0,02 |
| 1,643 % fällig am 25.08.2042 | | 134 | 128 | 0,00 |
| 1,657 % fällig am 25.06.2042 | | 73 | 71 | 0,00 |
| 2,149 % fällig am 25.07.2046 | | 584 | 527 | 0,02 |
| 2,151 % fällig am 25.08.2046 | | 5.781 | 5.203 | 0,17 |
| 2,151 % fällig am 25.11.2046 | | 6.054 | 5.462 | 0,18 |
| 2,151 % fällig am 25.12.2046 | | 485 | 448 | 0,01 |
| 2,155 % fällig am 25.05.2037 (a) | | 102 | 85 | 0,00 |
| 2,231 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 257 | 226 | 0,01 |
| 2,292 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 69 | 62 | 0,00 |
| 2,337 % fällig am 25.03.2036 | | 54 | 52 | 0,00 |
| 2,408 % fällig am 25.09.2036 (a) | | 473 | 430 | 0,01 |
| 2,439 % fällig am 25.03.2034 | | 1.572 | 1.578 | 0,05 |
| 2,563 % fällig am 25.09.2033 | | 236 | 234 | 0,01 |
| 4,294 % fällig am 25.02.2037 (a) | | 569 | 528 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates WMABS Trust** | | | | |
| 0,572 % fällig am 25.05.2036 | $ | 2.176 | $ 1.537 | 0,05 |
| 0,662 % fällig am 25.05.2036 | | 1.512 | 1.084 | 0,04 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Trust** | | | | |
| 0,977 % fällig am 25.12.2046 | | 10.301 | 7.016 | 0,23 |
| 1,022 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 1.545 | 818 | 0,03 |
| 1,122 % fällig am 25.01.2036 (a) | | 1.151 | 842 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 1.882 | 1.838 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 (a) | | 1.069 | 968 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2035 (a) | | 415 | 319 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 908 | 850 | 0,03 |
| **Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,193 % fällig am 25.02.2033 | | 8 | 8 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,772 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 1.535 | 1.090 | 0,04 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 1,472 % fällig am 25.10.2034 | | 703 | 663 | 0,02 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.03.2035 | | 128 | 128 | 0,00 |
| 2,736 % fällig am 25.10.2033 | | 136 | 137 | 0,00 |
| 2,738 % fällig am 25.07.2036 (a) | | 475 | 462 | 0,02 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 (a) | | 95 | 93 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 (a) | | 287 | 283 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (a) | | 350 | 350 | 0,01 |
| | | | 1.088.969 | 36,19 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACAS CLO Ltd.** | | | | |
| 1,670 % fällig am 25.10.2025 | | 9.000 | 8.865 | 0,29 |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | | 1.396 | 1.399 | 0,05 |
| **Atlas Senior Loan Fund III Ltd.** | | | | |
| 1,564 % fällig am 18.08.2025 | | 14.000 | 13.781 | 0,46 |
| **Avoca CLO VI PLC** | | | | |
| 0,259 % fällig am 16.01.2023 | € | 111 | 121 | 0,00 |
| **Belle Haven ABS CDO Ltd.** | | | | |
| 0,694 % fällig am 03.11.2044 | $ | 9.182 | 4.660 | 0,15 |
| 0,734 % fällig am 03.11.2044 | | 13.792 | 6.999 | 0,23 |
| **Benefit Street Partners CLO VI Ltd.** | | | | |
| 1,865 % fällig am 18.04.2027 | | 10.000 | 9.932 | 0,33 |
| **Bilkreditt 4 Ltd.** | | | | |
| 0,249 % fällig am 25.12.2027 | € | 9.916 | 10.776 | 0,36 |
| **BlackRock Senior Income** | | | | |
| 0,557 % fällig am 20.04.2019 | $ | 152 | 152 | 0,00 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 1,441 % fällig am 15.07.2025 | | 13.110 | 12.876 | 0,43 |
| **Cavendish Square Funding PLC** | | | | |
| 0,197 % fällig am 11.02.2055 | € | 10.837 | 11.407 | 0,38 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 0,601 % fällig am 10.05.2021 | $ | 2.454 | 2.438 | 0,08 |
| 0,674 % fällig am 01.03.2021 | | 444 | 441 | 0,01 |
| **Eaton Vance CDO VII PLC** | | | | |
| 0,119 % fällig am 25.03.2026 | € | 1.291 | 1.399 | 0,05 |
| **Educational Funding Co. LLC** | | | | |
| 0,570 % fällig am 25.10.2029 | $ | 601 | 561 | 0,02 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 0,187 % fällig am 23.10.2021 | € | 62 | 67 | 0,00 |
| **Faxtor ABS BV** | | | | |
| 0,202 % fällig am 02.11.2070 | | 3.073 | 3.275 | 0,11 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,152 % fällig am 20.04.2022 | | 4.101 | 4.451 | 0,15 |
| **GoldenTree Loan Opportunities VII Ltd.** | | | | |
| 1,470 % fällig am 25.04.2025 | $ | 13.000 | 12.758 | 0,42 |
| **Greywolf CLO V Ltd.** | | | | |
| 1,920 % fällig am 25.04.2027 | | 13.000 | 12.926 | 0,43 |
| **Hewett's Island CLO I-R Ltd.** | | | | |
| 0,756 % fällig am 12.11.2019 | | 811 | 805 | 0,03 |
| **Huntington CDO Ltd.** | | | | |
| 0,604 % fällig am 05.11.2040 | | 8.373 | 7.954 | 0,26 |
| **Inwood Park CDO Ltd.** | | | | |
| 0,542 % fällig am 20.01.2021 | | 1.253 | 1.252 | 0,04 |
| **Madison Park Funding X Ltd.** | | | | |
| 1,687 % fällig am 20.01.2025 | | 12.000 | 11.972 | 0,40 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 1,270 % fällig am 25.04.2038 | $ | 3.491 | $ 3.474 | 0,12 |
| **Monroe Capital BSL CLO Ltd.** | | | | |
| 1,958 % fällig am 22.05.2027 | | 2.000 | 1.982 | 0,07 |
| **Mountain View Funding CLO Ltd.** | | | | |
| 0,581 % fällig am 15.04.2019 | | 249 | 248 | 0,01 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | |
| 0,682 % fällig am 26.02.2029 | | 2.000 | 1.872 | 0,06 |
| **Newcastle CDO V Ltd.** | | | | |
| 0,934 % fällig am 24.12.2039 | | 372 | 367 | 0,01 |
| **OHA Credit Partners VIII Ltd.** | | | | |
| 1,437 % fällig am 20.04.2025 | | 4.000 | 3.914 | 0,13 |
| **Penta CLO 1 S.A.** | | | | |
| 0,172 % fällig am 04.06.2024 | € | 5.792 | 6.233 | 0,21 |
| **SC Germany Auto UG** | | | | |
| 0,194 % fällig am 12.10.2022 | | 5.688 | 6.179 | 0,21 |
| **Sierra Madre Funding Ltd.** | | | | |
| 0,649 % fällig am 07.09.2039 | $ | 8.171 | 6.537 | 0,22 |
| 0,669 % fällig am 07.09.2039 | | 18.589 | 14.825 | 0,49 |
| **Silver Arrow S.A. 4** | | | | |
| 0,102 % fällig am 20.10.2021 | € | 13.762 | 14.947 | 0,50 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,132 % fällig am 15.12.2023 | | 1.626 | 1.708 | 0,06 |
| 1,820 % fällig am 25.04.2023 | $ | 1.592 | 1.595 | 0,05 |
| **Stone Tower CLO VI Ltd.** | | | | |
| 0,545 % fällig am 17.04.2021 | | 460 | 455 | 0,02 |
| **Tralee CLO III Ltd.** | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.07.2026 | | 12.900 | 12.721 | 0,42 |
| **Triaxx Prime CDO Ltd.** | | | | |
| 0,688 % fällig am 02.10.2039 | $ | 33.471 | $ 28.922 | 0,96 |
| **Voya CLO III Ltd.** | | | | |
| 0,567 % fällig am 13.12.2020 | | 351 | 350 | 0,01 |
| | | | 247.596 | 8,23 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.11.2016 | € | 100 | 110 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 04.06.2018 | | 300 | 345 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 200 | 234 | 0,01 |
| **Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F** | | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2021 | BRL | 32.400 | 6.539 | 0,22 |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | | 237.500 | 42.951 | 1,43 |
| **Corporation Andina de Fomento** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 | MXN | 115.283 | 6.654 | 0,22 |
| **Greece Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 08.11.2016 | JPY | 5.530.000 | 43.672 | 1,45 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 | € | 50 | 68 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 01.09.2044 | | 11.200 | 17.213 | 0,57 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.11.2016 | | 29.800 | 33.629 | 1,12 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 900 | 995 | 0,03 |
| 5,850 % fällig am 10.05.2023 | | 1.400 | 1.598 | 0,05 |
| | | | 154.008 | 5,12 |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANCIALS** | | | | |
| **National Bank of Greece S.A.** | | 3.077.100 | $ 1.137 | 0,04 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (i)** | | 2.161.900 | 217.487 | 7,23 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (i)** | | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | | 1.601.914 | 16.022 | 0,53 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 3.995.521** | **132,79** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 6.756 | $ (4.789) | (0,16) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2016 | 875 | (278) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2017 | 613 | (405) | (0,01) |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2016 | 693 | (319) | (0,01) |
| Australia Government 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 45 | 16 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 609 | (536) | (0,02) |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 1.281 | (508) | (0,02) |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 278 | (143) | 0,00 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 234 | 51 | 0,00 |
| US Treasury 30-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 72 | (26) | 0,00 |
| | | | | $ (6.937) | (0,23) |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - US Treasury 30-Year Bond March Futures | $ 200,000 | 16.02.2016 | 72 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| Call - US Treasury 30-Year Bond March Futures | 185,000 | 19.02.2016 | 234 | 2 | 4 | 0,00 |
| Put - US Treasury 5-Year Note March Futures | 109,000 | 19.02.2016 | 1.491 | 13 | 12 | 0,00 |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | 108,000 | 19.02.2016 | 354 | 3 | 5 | 0,00 |
| | | | | $ 18 | $ 22 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (6.915)** | **(0,23)** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 73.458 | $ (1.029) | (0,03) |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 57.500 | 274 | 0,01 |
| | | | | $ (755) | (0,02) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,350 % | 28.09.2017 | $ | 1.459.900 | $ 4.479 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 14.12.2017 | | 691.100 | 3.037 | 0,10 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 16.12.2017 | | 289.700 | 1.972 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 15.06.2018 | | 664.600 | 1.087 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | | 635.500 | 5.987 | 0,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2019 | | 433.050 | 4.558 | 0,15 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | | 353.000 | 3.458 | 0,11 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 % | 19.08.2025 | | 20.700 | 184 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | | 126.100 | 225 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | | 199.550 | 3.627 | 0,12 |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 0,950 % | 25.03.2025 | € | 13.100 | (124) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month EURIBOR | 1,000 % | 16.03.2026 | | 26.150 | 62 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,050 % | 23.09.2019 | £ | 29.200 | 185 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 18.03.2022 | | 61.600 | 461 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,250 % | 16.03.2046 | | 9.400 | 499 | 0,02 |
| Zahlung | IBMEXID | 7,500 % | 02.06.2021 | MXN | 79.700 | (75) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,430 % | 17.11.2021 | | 95.000 | (59) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 5,780 % | 29.09.2022 | | 647.200 | (383) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 7,740 % | 29.05.2024 | | 556.000 | (134) | (0,01) |
| Zahlung | IBMEXID | 7,650 % | 30.05.2024 | | 5.200 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 6,360 % | 09.06.2025 | | 33.200 | (27) | 0,00 |
| Zahlung | IBMEXID | 7,635 % | 09.06.2025 | | 55.000 | (12) | 0,00 |
| | | | | | | $ 29.006 | 0,96 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 28.251** | **0,94** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | | Ausübungskurs | Verfallsdatum | | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BOA | $ | 1,050 | 08.01.2016 | € | 24.300 | $ 234 | $ 1 | 0,00 |
| Put - OTC Euro versus US dollar | BPS | | 1,050 | 08.01.2016 | | 24.100 | 238 | 1 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH | 6,400 | 02.02.2016 | $ | 33.713 | 911 | 1.034 | 0,04 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | | 6,500 | 02.02.2016 | | 35.705 | 750 | 626 | 0,02 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | | 7,400 | 02.02.2016 | | 33.713 | 201 | 3 | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | | 7,500 | 02.02.2016 | | 35.705 | 196 | 2 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | | 6,443 | 16.08.2016 | | 23.600 | 135 | 128 | 0,01 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | | 6,434 | 17.08.2016 | | 15.800 | 101 | 82 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | | 6,442 | 17.08.2016 | | 15.700 | 82 | 85 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | | 6,444 | 17.08.2016 | | 4.000 | 22 | 22 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 2.870 | $ 1.984 | 0,07 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,700 % | 03.10.2016 | $ | 155.600 | $ 298 | $ 30 | 0,00 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,750 % | 27.10.2017 | | 109.100 | 5.439 | 2.254 | 0,07 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,750 % | 27.11.2017 | | 78.200 | 3.904 | 1.724 | 0,06 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,350 % | 12.09.2016 | | 28.400 | 778 | 318 | 0,01 |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 0,950 % | 06.01.2016 | | 504.300 | 555 | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,900 % | 04.02.2016 | | 888.000 | 2.087 | 9 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,900 % | 18.02.2016 | | 874.800 | 2.274 | 28 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 % | 06.09.2016 | | 390.300 | 2.824 | 1.512 | 0,05 |
| | | | | | | | | $ 18.159 | $ 5.875 | 0,19 |

| Beschreibung | Kontrahent | | Ausübungskurs | Verfallsdatum | | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF WERTPAPIERE** | | | | | | | | | |
| Call - Fannie Mae | JPM | $ | 122,000 | 04.02.2016 | $ | 300.000 | $ 12 | $ 0 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG-25 Index | BOA | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | $ 13.600 | $ (24) | $ (11) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 44.600 | (79) | (37) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,000 % | 17.02.2016 | 18.000 | (31) | (29) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | 6.800 | (15) | (7) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | CBK | Verkauf | 0,950 % | 20.01.2016 | 6.400 | (14) | (5) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 13.300 | (25) | (3) | 0,00 |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 59.100 | (125) | (55) | (0,01) |
| Put - CDX.IG-25 Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 13.300 | (28) | (7) | 0,00 |
| | | | | | | $ (341) | $ (154) | (0,01) |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BPS | $ 1,102 | 08.01.2016 | € 24.100 | $ (238) | $ (18) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | BOA | 1,103 | 08.01.2016 | 24.300 | (234) | (17) | 0,00 |
| Call - OTC Euro versus US dollar | JPM | 1,130 | 04.03.2016 | 30.400 | (243) | (120) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | JPM | BRL 3,960 | 10.03.2016 | $ 17.980 | (577) | (917) | (0,03) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | BOA | 4,250 | 17.03.2016 | 850 | (19) | (22) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | 4,250 | 17.03.2016 | 18.950 | (428) | (485) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Brazilian real | JPM | 4,250 | 17.03.2016 | 23.300 | (562) | (596) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | JPM | CNH 6,900 | 02.02.2016 | 67.426 | (711) | (66) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | UAG | 7,000 | 02.02.2016 | 71.411 | (655) | (39) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,969 | 16.08.2016 | 23.600 | (279) | (303) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | HUS | 6,975 | 17.08.2016 | 15.700 | (182) | (200) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | SOG | 6,976 | 17.08.2016 | 4.000 | (47) | (51) | 0,00 |
| Call - OTC US dollar versus Chinese renminbi | BPS | 6,982 | 17.08.2016 | 15.800 | (196) | (198) | (0,01) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | CBK | RUB 71,500 | 18.02.2016 | 16.300 | (334) | (743) | (0,03) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 72,500 | 01.03.2016 | 16.100 | (328) | (678) | (0,02) |
| Call - OTC US dollar versus Russian ruble | SOG | 79,000 | 08.04.2016 | 16.700 | (262) | (393) | (0,01) |
| | | | | | $ (5.295) | $ (4.846) | (0,16) |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | BOA | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 04.02.2016 | $ 15.300 | $ (30) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 5,200 % | 29.07.2016 | 387.600 | (4.747) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 03.10.2016 | 33.100 | (298) | (105) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,460 % | 27.11.2017 | 90.700 | (1.656) | (437) | (0,01) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,525 % | 27.11.2017 | 104.200 | (2.150) | (457) | (0,02) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.11.2017 | 133.600 | (2.322) | (566) | (0,02) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,250 % | 12.09.2016 | 28.400 | (784) | (522) | (0,02) |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,750 % | 06.01.2016 | 109.200 | (1.231) | 0 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 04.02.2016 | 872.700 | (1.833) | (23) | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,495 % | 18.02.2016 | 874.800 | (1.837) | (63) | 0,00 |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,530 % | 29.02.2016 | 332.500 | (4.084) | 0 | 0,00 |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,272 % | 06.09.2016 | 88.700 | (2.821) | (1.683) | (0,06) |
| Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,550 % | 27.10.2017 | 458.300 | (7.856) | (1.769) | (0,06) |
| | | | | | | | $ (31.649) | $ (5.625) | (0,19) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | CBK | $ 1.000 | $ 2 | $ (6) | $ 8 | 0,00 |
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 4.000 | 7 | (32) | 39 | 0,00 |
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 3.000 | 5 | (24) | 29 | 0,00 |
| Abu Dhabi Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | MYC | 8.000 | 14 | (61) | 75 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway Finance Corp. | 1,000 % | 20.03.2023 | BOA | 1.600 | 4 | (61) | 65 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | BOA | 300 | 5 | 5 | 0 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | BOA | 7.300 | 130 | 213 | (83) | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 39.000 | 685 | 715 | (30) | 0,02 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | 6.100 | 109 | 178 | (69) | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 14.100 | 247 | 172 | 75 | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2020 | DUB | 16.300 | 263 | (208) | 471 | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | FBF | 8.000 | 143 | 234 | (91) | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2018 | GST | 17.300 | 287 | 489 | (202) | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 7.300 | 130 | 217 | (87) | 0,01 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | CBK | 2.300 | (25) | (33) | 8 | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2017 | CBK | 7.200 | (141) | (81) | (60) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 17.300 | (187) | (256) | 69 | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | DUB | 2.600 | (225) | (125) | (100) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | GST | 3.000 | (260) | (140) | (120) | (0,01) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 300 | (29) | (13) | (16) | 0,00 |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | MYC | 9.500 | (822) | (425) | (397) | (0,03) |
| Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 6.800 | (789) | (137) | (652) | (0,03) |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | BRC | 31.900 | 280 | 125 | 155 | 0,01 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2019 | CBK | $ 59.900 | $ 525 | $ 334 | $ 191 | 0,02 |
| China Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | CBK | 29.400 | 151 | 311 | (160) | 0,01 |
| Citigroup, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 6.400 | 88 | 66 | 22 | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 % | 20.09.2021 | CBK | 2.500 | 207 | 216 | (9) | 0,01 |
| Ford Motor Co. | 5,000 % | 20.03.2019 | DUB | 4.400 | 593 | 820 | (227) | 0,02 |
| Ford Motor Co. | 5,000 % | 20.03.2019 | JPM | 4.500 | 606 | 839 | (233) | 0,02 |
| Ford Motor Co. | 5,000 % | 20.03.2019 | MYC | 4.700 | 633 | 872 | (239) | 0,02 |
| General Electric Capital Corp. | 1,000 % | 20.09.2017 | BRC | 14.400 | 204 | 325 | (121) | 0,01 |
| General Electric Capital Corp. | 1,000 % | 20.06.2016 | DUB | 14.800 | 69 | 220 | (151) | 0,00 |
| General Electric Capital Corp. | 1,000 % | 20.09.2017 | DUB | 5.400 | 76 | 117 | (41) | 0,00 |
| General Electric Capital Corp. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 14.100 | 325 | 165 | 160 | 0,01 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.12.2017 | BRC | 18.000 | 212 | (720) | 932 | 0,01 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 % | 20.09.2016 | MYC | 25.900 | 142 | 345 | (203) | 0,01 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 2.200 | 34 | 43 | (9) | 0,00 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,000 % | 20.03.2019 | GST | 3.850 | 60 | 74 | (14) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | BRC | 14.300 | 192 | 271 | (79) | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 22.200 | 327 | 205 | 122 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | GST | 7.200 | 97 | 140 | (43) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | BOA | 59.500 | (321) | 142 | (463) | (0,01) |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | DUB | 12.500 | 47 | 143 | (96) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2018 | FBF | 5.500 | (30) | 17 | (47) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 12.500 | 47 | 145 | (98) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | HUS | 11.500 | 44 | 143 | (99) | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2016 | MYC | 27.100 | 103 | 315 | (212) | 0,00 |
| Morgan Stanley | 1,000 % | 20.03.2019 | JPM | 2.000 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| Portugal Obrigacoes do Tesouro OT | 1,000 % | 20.03.2016 | CBK | 12.300 | 24 | (79) | 103 | 0,00 |
| Portugal Obrigacoes do Tesouro OT | 1,000 % | 20.03.2016 | GST | 8.200 | 16 | (43) | 59 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.03.2019 | DUB | 7.000 | 104 | 78 | 26 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | FBF | 3.000 | 41 | 61 | (20) | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 % | 20.09.2019 | GST | 4.500 | 61 | 91 | (30) | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | CBK | 2.000 | 4 | (13) | 17 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | DUB | 4.500 | 8 | (37) | 45 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2016 | HUS | 4.500 | 8 | (35) | 43 | 0,00 |
| Qatar Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2019 | JPM | 26.800 | 295 | 549 | (254) | 0,01 |
| State of California | 1,000 % | 20.09.2019 | GST | 3.200 | 43 | 86 | (43) | 0,00 |
| State of California | 1,000 % | 20.09.2024 | MYC | 2.900 | (40) | 23 | (63) | 0,00 |
| US-Bundesstaat Ohio | 1,000 % | 20.09.2019 | GST | 3.200 | 70 | 92 | (22) | 0,00 |
| US-Bundesstaat Ohio | 1,000 % | 20.09.2019 | MYC | 1.600 | 35 | 47 | (12) | 0,00 |
| Teck Resources Ltd. | 1,000 % | 20.09.2019 | CBK | 4.100 | (1.675) | (66) | (1.609) | (0,05) |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BOA | € 1.000 | (1) | (8) | 7 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | BPS | 1.300 | (2) | (17) | 15 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2016 | GST | 1.300 | (2) | (17) | 15 | 0,00 |
| | | | | | $ 3.278 | $ 7.006 | $ (3.728) | 0,11 |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | DUB | BRL 500 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | GLM | 167.100 | (102) | (1) | (101) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,240 % | 02.01.2017 | HUS | 24.000 | (15) | (1) | (14) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | GLM | 67.500 | (1.189) | 1 | (1.190) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,180 % | 02.01.2018 | MYC | 80.900 | (1.425) | 12 | (1.437) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | DUB | 477.000 | (7.724) | (6.456) | (1.268) | (0,26) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,360 % | 02.01.2018 | FBF | 308.400 | (4.994) | (2.041) | (2.953) | (0,17) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BPS | 57.600 | (155) | (29) | (126) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | BRC | 17.600 | (47) | (17) | (30) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | CBK | 46.300 | (125) | (9) | (116) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | DUB | 106.100 | (285) | (54) | (231) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | FBF | 4.000 | (11) | 0 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | GLM | 30.900 | (83) | 7 | (90) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 15,500 % | 02.01.2018 | MYC | 13.200 | (35) | 3 | (38) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,160 % | 04.01.2021 | BOA | 63.000 | (2.443) | (115) | (2.328) | (0,08) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,160 % | 04.01.2021 | BPS | 38.800 | (1.505) | (76) | (1.429) | (0,05) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,160 % | 04.01.2021 | DUB | 73.200 | (2.838) | (132) | (2.706) | (0,10) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | DUB | 3.000 | (100) | 10 | (110) | 0,00 |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | FBF | 93.200 | (3.114) | 382 | (3.496) | (0,10) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 11,680 % | 04.01.2021 | MYC | 135.600 | (4.530) | 464 | (4.994) | (0,15) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | BOA | 96.800 | (2.870) | 252 | (3.122) | (0,10) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | BPS | 128.300 | (3.804) | 16 | (3.820) | (0,13) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | DUB | 91.900 | (2.725) | (23) | (2.702) | (0,09) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,055 % | 04.01.2021 | HUS | 74.600 | (2.212) | (148) | (2.064) | (0,07) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | BOA | BRL 11.500 | $ (320) | $ 5 | $ (325) | (0,01) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | DUB | 93.100 | (2.595) | (153) | (2.442) | (0,09) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | FBF | 28.600 | (797) | 51 | (848) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,230 % | 04.01.2021 | MYC | 39.700 | (1.106) | 26 | (1.132) | (0,04) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,560 % | 04.01.2021 | FBF | 77.900 | (1.886) | (8) | (1.878) | (0,06) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,600 % | 04.01.2021 | BPS | 227.900 | (5.881) | 19 | (5.900) | (0,19) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,600 % | 04.01.2021 | DUB | 95.100 | (2.454) | 4 | (2.458) | (0,08) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | CBK | 37.700 | (919) | (7) | (912) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | DUB | 36.500 | (890) | (8) | (882) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | GLM | 114.400 | (2.790) | 73 | (2.863) | (0,09) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | HUS | 38.300 | (934) | (26) | (908) | (0,03) |
| Zahlung | BRL-CDI-Compounded | 12,810 % | 04.01.2021 | MYC | 73.400 | (1.790) | 160 | (1.950) | (0,06) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,740 % | 26.01.2020 | GLM | € 53.700 | (250) | (180) | (70) | (0,01) |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,710 % | 29.01.2020 | BOA | 37.200 | (110) | (43) | (67) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,660 % | 30.01.2020 | GLM | 83.000 | (13) | (7) | (6) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,700 % | 30.01.2020 | BPS | 34.300 | (82) | (5) | (77) | 0,00 |
| Erhalt | Eurostat Eurozone HICP Ex Tobacco Unrevised Series NSA | 0,993 % | 30.03.2020 | GLM | 60.100 | (786) | (8) | (778) | (0,03) |
| Zahlung | IBMEXID | 7,650 % | 30.05.2024 | HUS | MXN 120.800 | 106 | 7 | 99 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | CBK | £ 890 | 46 | (1) | 47 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,400 % | 15.06.2030 | FBF | 600 | 31 | 4 | 27 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | DUB | 9.242 | 78 | (11) | 89 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | JPM | 1.870 | 16 | 3 | 13 | 0,00 |
| Zahlung | UK Retail Price Index | 3,300 % | 15.11.2030 | MYC | 6.840 | 57 | (10) | 67 | 0,00 |
| | | | | | | $ (65.600) | $ (8.070) | $ (57.530) | (2,18) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 38.452 | AUD | 53.614 | AZD | $ 555 | $ 0 | $ 555 | 0,02 |
| 01/2016 | AUD | 53.614 | $ | 38.833 | UAG | 0 | (174) | (174) | (0,01) |
| 01/2016 | BRL | 559.674 | | 140.340 | BOA | 0 | (1.126) | (1.126) | (0,04) |
| 01/2016 | $ | 143.331 | BRL | 559.674 | BOA | 0 | (1.865) | (1.865) | (0,06) |
| 01/2016 | BRL | 13.585 | $ | 3.440 | BPS | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.479 | BRL | 13.585 | BPS | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 648.629 | $ | 166.031 | DUB | 2.080 | 0 | 2.080 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 171.528 | BRL | 648.629 | DUB | 0 | (7.577) | (7.577) | (0,25) |
| 01/2016 | | 4.606 | | 17.986 | FBF | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 17.986 | $ | 4.600 | FBF | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 8.585 | BRL | 33.522 | JPM | 0 | (112) | (112) | 0,00 |
| 01/2016 | BRL | 33.522 | $ | 8.550 | JPM | 77 | 0 | 77 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 12.956 | CAD | 17.993 | BOA | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 17.993 | $ | 13.503 | JPM | 550 | 0 | 550 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 29.569 | CNH | 195.303 | HUS | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| 01/2016 | CNH | 497.066 | $ | 76.120 | HUS | 769 | 0 | 769 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 5.630 | CNH | 37.072 | RBC | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | | 178 | € | 164 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 13.731 | $ | 14.640 | BOA | 0 | (276) | (276) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 4.707 | € | 4.395 | BPS | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 972 | $ | 1.058 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 6.094 | € | 5.654 | CBK | 48 | 0 | 48 | 0,00 |
| 01/2016 | | 21.073 | | 19.477 | GLM | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 143.207 | $ | 152.613 | HUS | 0 | (2.954) | (2.954) | (0,10) |
| 01/2016 | $ | 7.370 | € | 6.757 | RBC | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | | 140.326 | | 128.469 | UAG | 0 | (771) | (771) | (0,03) |
| 01/2016 | | 1.032 | £ | 681 | BOA | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 1.386 | $ | 2.087 | BOA | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| 01/2016 | | 132 | | 202 | BPS | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 136.423 | £ | 91.927 | CBK | 0 | (933) | (933) | (0,03) |
| 01/2016 | £ | 92.165 | $ | 138.938 | DUB | 3.097 | 0 | 3.097 | 0,10 |
| 01/2016 | $ | 1.792 | £ | 1.186 | UAG | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 111 | $ | 166 | UAG | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | JPY | 13.524.057 | | 110.221 | BOA | 0 | (2.204) | (2.204) | (0,07) |
| 01/2016 | $ | 111.695 | JPY | 13.524.057 | MSB | 729 | 0 | 729 | 0,02 |
| 01/2016 | | 2.023 | KRW | 2.294.082 | BOA | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.023 | | 2.293.677 | BPS | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.910 | | 10.102.158 | BRC | 0 | (318) | (318) | (0,01) |
| 01/2016 | | 39.209 | | 44.581.981 | DUB | 0 | (1.291) | (1.291) | (0,04) |
| 01/2016 | | 4.898 | | 5.550.190 | GLM | 0 | (177) | (177) | (0,01) |
| 01/2016 | | 2.023 | | 2.293.742 | HUS | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| 01/2016 | KRW | 32.487.374 | $ | 70.130 | JPM | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 2.111 | KRW | 2.389.652 | JPM | 0 | (79) | (79) | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.468 | | 2.797.478 | MSB | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.910 | | 10.106.168 | NGF | 0 | (315) | (315) | (0,01) |
| 01/2016 | | 17 | SGD | 24 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | AUD | 53.614 | $ | 38.398 | AZD | 0 | (554) | (554) | (0,02) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des Unconstrained Bond Fund (Forts.)

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 02/2016 | $ | 38.444 | AUD | 54.725 | CBK | $ 1.297 | $ 0 | $ 1.297 | 0,04 |
| 02/2016 | | 138.915 | BRL | 559.674 | BOA | 1.114 | 0 | 1.114 | 0,04 |
| 02/2016 | | 5.615 | | 21.941 | SOG | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| 02/2016 | CAD | 17.993 | $ | 12.957 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 11.885 | CAD | 15.782 | MSB | 0 | (522) | (522) | (0,02) |
| 02/2016 | CHF | 89 | $ | 91 | CBK | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| 02/2016 | | 1.845 | | 1.840 | JPM | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| 02/2016 | DKK | 2.195 | | 317 | UAG | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 12.101 | € | 11.069 | CBK | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 10.800 | $ | 14.534 | DUB | 2.794 | 0 | 2.794 | 0,09 |
| 02/2016 | $ | 4.704 | € | 4.296 | JPM | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 02/2016 | € | 128.469 | $ | 140.425 | UAG | 771 | 0 | 771 | 0,03 |
| 02/2016 | £ | 91.927 | | 136.427 | CBK | 926 | 0 | 926 | 0,03 |
| 02/2016 | $ | 1.611 | £ | 1.079 | CBK | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 02/2016 | | 18.668 | | 12.538 | JPM | 0 | (186) | (186) | (0,01) |
| 02/2016 | HKD | 7.300 | $ | 942 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | ILS | 486 | | 125 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1.320 | INR | 89.266 | CBK | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| 02/2016 | | 115.164 | JPY | 14.171.400 | JPM | 2.740 | 0 | 2.740 | 0,09 |
| 02/2016 | JPY | 13.524.057 | $ | 111.760 | MSB | 0 | (735) | (735) | (0,02) |
| 02/2016 | NOK | 885 | | 103 | HUS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | SEK | 5.330 | | 615 | CBK | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 8 | | 6 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 2.768 | TWD | 91.087 | BPS | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| 02/2016 | TWD | 968.266 | $ | 29.775 | SCX | 435 | 0 | 435 | 0,01 |
| 03/2016 | MXN | 214.252 | | 12.290 | NGF | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| 05/2016 | BRL | 68.681 | | 19.584 | BOA | 2.910 | 0 | 2.910 | 0,10 |
| 05/2016 | | 93.866 | | 26.629 | JPM | 3.841 | 0 | 3.841 | 0,13 |
| 05/2016 | | 23.062 | | 6.545 | MSB | 946 | 0 | 946 | 0,03 |
| 05/2016 | ZAR | 7.190 | | 486 | BOA | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| 06/2016 | € | 252.328 | | 345.018 | BOA | 69.635 | 0 | 69.635 | 2,31 |
| 06/2016 | $ | 47.372 | € | 43.686 | BOA | 327 | 0 | 327 | 0,01 |
| 06/2016 | | 276.947 | | 252.328 | BOA | 1.583 | (3.146) | (1.563) | (0,05) |
| 06/2016 | € | 43.686 | $ | 60.148 | BOA | 12.448 | 0 | 12.448 | 0,41 |
| 06/2016 | | 48.342 | | 66.473 | BRC | 13.689 | 0 | 13.689 | 0,46 |
| 06/2016 | $ | 34.003 | € | 25.668 | DUB | 54 | (6.043) | (5.989) | (0,20) |
| 06/2016 | € | 25.668 | $ | 35.145 | DUB | 7.131 | 0 | 7.131 | 0,24 |
| 06/2016 | $ | 73.524 | € | 67.590 | MSB | 241 | 0 | 241 | 0,01 |
| 06/2016 | € | 67.590 | $ | 92.960 | MSB | 19.194 | 0 | 19.194 | 0,64 |
| 06/2016 | | 73.094 | | 100.570 | NAB | 20.761 | 0 | 20.761 | 0,69 |
| 06/2016 | | 71.512 | | 97.993 | NAB | 19.947 | 0 | 19.947 | 0,66 |
| 06/2016 | $ | 79.227 | € | 73.094 | NAB | 583 | 0 | 583 | 0,02 |
| 07/2016 | BRL | 15.189 | $ | 4.223 | BPS | 609 | 0 | 609 | 0,02 |
| 07/2016 | | 87.678 | | 24.467 | GLM | 3.607 | 0 | 3.607 | 0,12 |
| 07/2016 | $ | 114.352 | € | 104.025 | NAB | 0 | (633) | (633) | (0,02) |
| 07/2016 | € | 104.025 | $ | 141.120 | NAB | 27.402 | 0 | 27.402 | 0,91 |
| 08/2016 | CNH | 104.549 | | 15.800 | BPS | 272 | 0 | 272 | 0,01 |
| 08/2016 | | 55.179 | | 8.339 | HUS | 143 | 0 | 143 | 0,01 |
| 08/2016 | | 103.840 | | 15.700 | HUS | 277 | 0 | 277 | 0,01 |
| 08/2016 | | 78.092 | | 11.800 | SCX | 200 | 0 | 200 | 0,01 |
| 08/2016 | | 26.448 | | 4.000 | SOG | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| 08/2016 | | 22.877 | | 3.461 | UAG | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| 10/2016 | | 1.071.170 | | 163.850 | DUB | 5.494 | 0 | 5.494 | 0,18 |
| 10/2016 | | 73.689 | | 11.274 | UAG | 380 | 0 | 380 | 0,01 |
| 10/2016 | JPY | 5.408.956 | | 76.448 | DUB | 31.053 | 0 | 31.053 | 1,03 |
| 01/2017 | BRL | 90.000 | | 32.674 | MSB | 12.461 | 0 | 12.461 | 0,41 |
| 01/2017 | | 100.000 | | 35.997 | UAG | 13.539 | 0 | 13.539 | 0,45 |
| 07/2017 | | 174.400 | | 59.870 | BPS | 22.962 | 0 | 22.962 | 0,76 |
| 07/2017 | | 246.000 | | 86.117 | UAG | 34.057 | 0 | 34.057 | 1,13 |
| 01/2021 | | 4.740 | | 731 | HUS | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | | | | | | $ 344.273 | $ (32.877) | $ 311.396 | 10,35 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 246.308** | **8,18** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae TBA (k)** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ (83.100) | $ (83.107) | (2,76) |
| 3,500 % fällig am 01.02.2046 | (41.300) | (42.525) | (1,41) |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | (58.900) | (62.331) | (2,07) |
| 4,000 % fällig am 01.02.2046 | (195.000) | (205.970) | (6,85) |
| | | $ (393.933) | (13,09) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (393.933)** | **(13,09)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 3.869.232** | **128,59** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 77 | $ 56 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 65 | 96 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 5 | 5 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.01.2016 | NZD | 7 | 5 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 63 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 140 | 140 | 0,01 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 20 | 15 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK | 4 | 1 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 23 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 1 | 0 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 24 | 3 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SEK | 3.400 | 403 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 2 | 2 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | | 44 | 44 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CHF | 2 | 2 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2 | 2 | 0,00 |
| **HSBC Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | HKD | 2.078 | 268 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | SGD | 3 | 2 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 42 | 42 | 0,00 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 45 | 33 | 0,00 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | NOK | 244 | 28 | 0,00 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 720 | 518 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 2.250 | 2.444 | 0,08 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | £ | 21 | 30 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 26 | 0 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | $ | 1 | 1 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 4.147** | **0,14** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (864.432)** | **(28,73)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 3.008.947** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(b) **Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

(c) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.025.529 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(e) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 56.626 und Barmittel von USD 3.770 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheiten für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.903 und Barmittel in Höhe von USD 1.294 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(g) **Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 9.690 und Barmittel in Höhe von USD 290 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

(h) **Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

(i) **Der Unconstrained Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(j) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 35.876 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(k) **Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(l) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 314.140 | $ 3.660.463 | $ 20.918 | $ 3.995.521 |
| Finanzderivate[3] | (6.915) | 274.559 | 0 | 267.644 |
| Leerverkäufe | 0 | (393.933) | 0 | (393.933) |
| **Summen** | **$ 307.225** | **$ 3.541.089** | **$ 20.918** | **$ 3.869.232** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 469.584 | $ 5.204.646 | $ 30.528 | $ 5.704.758 |
| Finanzderivate[3] | 4.684 | 203.595 | 0 | 208.279 |
| Leerverkäufe | 0 | (1.103.025) | 0 | (1.103.025) |
| **Summen** | **$ 474.268** | **$ 4.305.216** | **$ 30.528** | **$ 4.810.012** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(m) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Class Z AUD (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | AUD | 13.198 | $ | 9.466 | AZD | $ 0 | $ (137) | $ (137) | 0,00 |
| 01/2016 | | 512 | | 372 | BOA | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 144 | AUD | 200 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 425 | $ | 309 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 13.318 | | 9.679 | CBK | 1 | (11) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 90 | AUD | 125 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 23 | $ | 17 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.441 | AUD | 13.076 | GLM | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 13.235 | $ | 9.622 | JPM | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.453 | AUD | 13.139 | NAB | 107 | 0 | 107 | 0,00 |
| 01/2016 | | 29 | | 40 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 7.470 | | 10.387 | SCX | 87 | 0 | 87 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 4.472 | $ | 3.264 | SOG | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 10.667 | AUD | 14.736 | UAG | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| 01/2016 | AUD | 6.894 | $ | 4.984 | UAG | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.452 | AUD | 13.198 | AZD | 136 | 0 | 136 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 35 | $ | 25 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 9.605 | AUD | 13.235 | CBK | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.609 | | 13.235 | JPM | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | | 3.259 | | 4.472 | SOG | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 02/2016 | | 4.945 | | 6.849 | UAG | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | | | | | | $ 517 | $ (197) | $ 320 | 0,01 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional Institutional CHF (Hedged) Class, Investor CHF (Hedged) Class, Class E CHF (Hedged) und Class S CHF (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 27.201 | CHF | 27.928 | BOA | $ 699 | $ 0 | $ 699 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 151 | $ | 148 | BOA | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| 01/2016 | | 368 | | 362 | BPS | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | | 450 | | 450 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 32.116 | | 32.489 | CBK | 404 | 0 | 404 | 0,01 |
| 01/2016 | | 185 | | 184 | DUB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 31.899 | CHF | 32.569 | DUB | 637 | 0 | 637 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 779 | $ | 761 | FBF | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 31.815 | CHF | 32.496 | JPM | 648 | 0 | 648 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 31.938 | $ | 32.336 | JPM | 430 | 0 | 430 | 0,01 |
| 01/2016 | | 28.122 | | 28.384 | MSB | 295 | (4) | 291 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 32.106 | CHF | 32.604 | UAG | 465 | 0 | 465 | 0,02 |
| 01/2016 | CHF | 31.938 | $ | 32.332 | UAG | 427 | 0 | 427 | 0,01 |
| 02/2016 | | 200 | | 202 | BOA | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 32.349 | CHF | 31.937 | CBK | 0 | (404) | (404) | (0,01) |
| 02/2016 | | 32.376 | | 31.938 | JPM | 0 | (430) | (430) | (0,01) |
| 02/2016 | | 27.605 | | 27.311 | MSB | 0 | (287) | (287) | (0,01) |
| 02/2016 | | 32.370 | | 31.938 | UAG | 0 | (424) | (424) | (0,01) |
| | | | | | | $ 4.008 | $ (1.576) | $ 2.432 | 0,08 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class S EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € 186.135 | $ 204.392 | BOA | $ 2.283 | $ (89) | $ 2.194 | 0,08 |
| 01/2016 | $ 222.391 | € 208.586 | BOA | 4.196 | 0 | 4.196 | 0,14 |
| 01/2016 | € 2.775 | $ 3.038 | BPS | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 1.875 | € 1.764 | BPS | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| 01/2016 | € 478 | $ 519 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 83.306 | 90.931 | CBK | 608 | (171) | 437 | 0,02 |
| 01/2016 | 1.077 | 1.152 | DUB | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| 01/2016 | $ 97.873 | € 92.370 | GLM | 2.469 | 0 | 2.469 | 0,08 |
| 01/2016 | € 182.650 | $ 200.722 | HUS | 2.309 | 0 | 2.309 | 0,08 |
| 01/2016 | $ 223.043 | € 209.297 | HUS | 4.317 | 0 | 4.317 | 0,14 |
| 01/2016 | € 42.155 | $ 46.065 | JPM | 273 | 0 | 273 | 0,01 |
| 01/2016 | 1.440 | 1.531 | NAB | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| 01/2016 | 9.276 | 10.119 | RBC | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.256 | 1.376 | SCX | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 17 | € 16 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 220.777 | 207.742 | UAG | 4.894 | 0 | 4.894 | 0,16 |
| 01/2016 | € 210.311 | $ 229.541 | UAG | 1.238 | (158) | 1.080 | 0,04 |
| 02/2016 | $ 200.838 | € 182.650 | BOA | 0 | (2.285) | (2.285) | (0,08) |
| 02/2016 | € 4.747 | $ 5.216 | BOA | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 203.933 | € 185.455 | HUS | 0 | (2.330) | (2.330) | (0,08) |
| 02/2016 | 46.097 | 42.155 | JPM | 0 | (272) | (272) | (0,01) |
| 02/2016 | € 16 | $ 17 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 216.056 | € 197.660 | UAG | 0 | (1.186) | (1.186) | (0,04) |
| | | | | $ 22.760 | $ (6.542) | $ 16.218 | 0,54 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class, Investor GBP (Hedged) Class, Class E GBP (Hedged) und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | £ 7.416 | $ 11.166 | AZD | $ 236 | $ 0 | $ 236 | 0,01 |
| 01/2016 | 836 | 1.256 | BOA | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| 01/2016 | 54 | 81 | BPS | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 152.293 | £ 101.197 | BPS | 0 | (3.139) | (3.139) | (0,10) |
| 01/2016 | £ 751 | $ 1.107 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 172.175 | £ 113.964 | CBK | 0 | (4.205) | (4.205) | (0,14) |
| 01/2016 | £ 114.390 | $ 169.796 | CBK | 1.196 | 0 | 1.196 | 0,04 |
| 01/2016 | $ 172.091 | £ 114.156 | DUB | 0 | (3.836) | (3.836) | (0,13) |
| 01/2016 | £ 113.242 | $ 168.048 | JPM | 1.141 | 0 | 1.141 | 0,04 |
| 01/2016 | 113.242 | 167.653 | MSB | 746 | 0 | 746 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 174.969 | £ 116.054 | MSB | 0 | (3.916) | (3.916) | (0,13) |
| 01/2016 | £ 96.304 | $ 142.528 | SCX | 585 | 0 | 585 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 129 | £ 86 | UAG | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 02/2016 | 167.628 | 112.950 | CBK | 0 | (1.138) | (1.138) | (0,04) |
| 02/2016 | 168.054 | 113.242 | JPM | 0 | (1.134) | (1.134) | (0,04) |
| 02/2016 | 167.663 | 113.242 | MSB | 0 | (743) | (743) | (0,02) |
| 02/2016 | 142.539 | 96.304 | SCX | 0 | (585) | (585) | (0,02) |
| 02/2016 | £ 9 | $ 13 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 3.929 | $ (18.698) | $ (14.769) | (0,49) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional NOK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | NOK 152.249 | $ 17.419 | BOA | $ 219 | $ 0 | $ 219 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 17.186 | NOK 149.103 | BPS | 0 | (341) | (341) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 522 | $ 59 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 1.224 | 141 | CBK | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 235 | NOK 2.045 | CBK | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| 01/2016 | 14.280 | 124.285 | HUS | 0 | (239) | (239) | (0,01) |
| 01/2016 | 17.189 | 148.899 | JPM | 0 | (367) | (367) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 151.657 | $ 17.492 | JPM | 359 | 0 | 359 | 0,01 |
| 01/2016 | 850 | 99 | MSB | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 421 | NOK 3.632 | MSB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | 140 | 1.226 | RBC | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| 01/2016 | NOK 125.463 | $ 14.375 | SCX | 201 | 0 | 201 | 0,01 |
| 01/2016 | $ 17.697 | NOK 153.909 | SCX | 0 | (309) | (309) | (0,01) |
| 01/2016 | NOK 151.657 | $ 17.490 | UAG | 356 | 0 | 356 | 0,01 |
| 02/2016 | $ 17.415 | NOK 152.249 | BOA | 0 | (220) | (220) | (0,01) |
| 02/2016 | 17.488 | 151.657 | JPM | 0 | (359) | (359) | (0,01) |
| 02/2016 | 431 | 3.748 | MSB | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| 02/2016 | 14.371 | 125.463 | SCX | 0 | (201) | (201) | (0,01) |
| 02/2016 | 17.485 | 151.657 | UAG | 0 | (356) | (356) | (0,01) |
| | | | | $ 1.141 | $ (2.416) | $ (1.275) | (0,04) |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional SEK (Hedged) Class und Administrative SEK (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 53.445 | SEK | 466.089 | BOA | $ 1.840 | $ 0 | $ 1.840 | 0,06 |
| 01/2016 | SEK | 437.455 | $ | 52.393 | BOA | 504 | 0 | 504 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 53.384 | SEK | 467.204 | BPS | 2.034 | 0 | 2.034 | 0,07 |
| 01/2016 | SEK | 7.166 | $ | 850 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 53.769 | SEK | 467.567 | CBK | 1.692 | 0 | 1.692 | 0,05 |
| 01/2016 | SEK | 535.987 | $ | 64.162 | CBK | 674 | (89) | 585 | 0,02 |
| 01/2016 | | 37.400 | | 4.407 | DUB | 1 | (31) | (30) | 0,00 |
| 01/2016 | | 971 | | 114 | GLM | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.237 | | 618 | HUS | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 01/2016 | | 444.716 | | 53.108 | JPM | 366 | (9) | 357 | 0,01 |
| 01/2016 | | 329.462 | | 39.277 | MSB | 217 | (19) | 198 | 0,01 |
| 01/2016 | | 594 | | 71 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 2.254 | | 258 | SCX | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 45.961 | SEK | 400.800 | SCX | 1.580 | 0 | 1.580 | 0,05 |
| 01/2016 | SEK | 3.565 | $ | 422 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | | 5.973 | | 687 | UAG | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 52.434 | SEK | 437.455 | BOA | 0 | (501) | (501) | (0,02) |
| 02/2016 | | 60.592 | | 504.756 | CBK | 0 | (670) | (670) | (0,02) |
| 02/2016 | | 52.325 | | 437.688 | JPM | 0 | (364) | (364) | (0,01) |
| 02/2016 | | 37.626 | | 315.115 | MSB | 0 | (216) | (216) | (0,01) |
| 02/2016 | SEK | 10.295 | $ | 1.232 | MSB | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | $ 8.918 | $ (1.934) | $ 6.984 | 0,23 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die E SGD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 1 | SGD | 1 | CBK | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| 01/2016 | SGD | 1 | $ | 1 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 24 | | 17 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 1 | SGD | 1 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1 | $ | 1 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 68 | SGD | 96 | DUB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 135 | | 191 | HUS | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 02/2016 | SGD | 1 | $ | 1 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 136 | SGD | 191 | SCX | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |

**(n) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Administrative EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged), Class G Institutional EUR (Hedged), Class G Retail EUR (Hedged), Class R EUR (Hedged) und Class S EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 88.698 | $ 96.801 | $ (370) | $ 0 | $ (370) | (0,01) |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(o) Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOM | 0,450 % | 06.11.2015 | 05.02.2016 | $ 5.736 | $ (5.740) | (0,19) |
| BOS | 0,220 % | 30.12.2015 | 15.01.2016 | 8.020 | (8.020) | (0,27) |
| BOS | 0,520 % | 19.11.2015 | 19.01.2016 | 6.419 | (6.422) | (0,21) |
| BOS | 0,900 % | 02.12.2015 | 04.01.2016 | 39.572 | (39.602) | (1,32) |
| BSN | 0,450 % | 30.12.2015 | 12.01.2016 | 9.787 | (9.787) | (0,33) |
| BSN | 0,470 % | 09.11.2015 | 11.01.2016 | 72.442 | (72.492) | (2,41) |
| BSN | 0,500 % | 01.12.2015 | 12.01.2016 | 10.764 | (10.769) | (0,36) |
| BSN | 0,500 % | 30.12.2015 | 12.01.2016 | 148.026 | (148.030) | (4,92) |
| GRE | 0,670 % | 25.11.2015 | 06.01.2016 | 126.338 | (126.338) | (4,20) |
| GRE | 0,450 % | 04.11.2015 | 04.01.2016 | 1.773 | (1.774) | (0,06) |
| GRE | 0,520 % | 04.01.2016 | 04.02.2016 | 19.548 | (19.548) | (0,65) |
| GRE | 0,580 % | 30.12.2015 | 19.01.2016 | 7.535 | (7.535) | (0,25) |
| GRE | 0,600 % | 20.11.2015 | 20.01.2016 | 62.388 | (62.431) | (2,07) |
| GRE | 0,700 % | 27.11.2015 | 08.01.2016 | 1.346 | (1.346) | (0,04) |
| GRE | 0,800 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | 12.110 | (12.128) | (0,40) |

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GRE | 0,900 % | 10.12.2015 | 14.01.2016 | $ 12.805 | $ (12.812) | (0,43) |
| GRE | 0,900 % | 31.12.2015 | 14.01.2016 | 50.375 | (50.376) | (1,67) |
| GRE | 0,950 % | 11.12.2015 | 15.01.2016 | 3.531 | (3.533) | (0,12) |
| JPS | 0,350 % | 06.11.2015 | 06.01.2016 | 15.552 | (15.560) | (0,52) |
| JPS | 0,450 % | 20.11.2015 | 20.01.2016 | 70.429 | (70.466) | (2,34) |
| JPS | 0,480 % | 10.11.2015 | 11.01.2016 | 961 | (962) | (0,03) |
| JPS | 0,550 % | 19.11.2015 | 15.01.2016 | 115.331 | (115.407) | (3,84) |
| JPS | 0,560 % | 09.12.2015 | 20.01.2016 | 4.950 | (4.952) | (0,16) |
| JPS | 0,580 % | 09.12.2015 | 27.01.2016 | 10.296 | (10.300) | (0,34) |
| JPS | 0,650 % | 01.12.2015 | 04.01.2016 | 12.821 | (12.828) | (0,43) |
| JPS | 0,650 % | 02.12.2015 | 02.02.2016 | 5.270 | (5.273) | (0,17) |
| JPS | 0,700 % | 01.12.2015 | 12.01.2016 | 8.000 | (8.005) | (0,27) |
| RDR | 0,560 % | 30.12.2015 | 19.01.2016 | 154.990 | (154.995) | (5,15) |
| RDR | 0,560 % | 31.12.2015 | 20.01.2016 | 17.956 | (17.956) | (0,60) |
| SGY | 0,500 % | 04.01.2016 | 14.01.2016 | 12.773 | (12.773) | (0,42) |
| | | | | | $ (1.028.160) | (34,17) |

**(p) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MSC | 0,648 % | 23.11.2015 | 22.01.2016 | $ 5.038 | $ (5.050) | (0,17) |
| NOM | 0,608 % | 09.12.2015 | 20.01.2016 | 4.728 | (4.735) | (0,16) |
| | | | | | $ (9.785) | (0,33) |

[1] In dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 10 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(q) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 236 | $ 0 | $ 236 |
| BOA | 80.124 | (83.730) | (3.606) |
| BPS | 10.853 | (11.620) | (767) |
| BRC | 14.933 | (14.450) | 483 |
| CBK | (3.600) | 2.910 | (690) |
| DUB | 18.217 | (24.130) | (5.913) |
| FBF | (11.125) | 19.400 | 8.275 |
| GLM | 473 | (5.370) | (4.897) |
| GST | 478 | (640) | (162) |
| HUS | (987) | 480 | (507) |
| JPM | 7.059 | (7.500) | (441) |
| MSB | 28.294 | (29.050) | (756) |
| MYC | (11.412) | 10.390 | (1.022) |
| NAB | 68.134 | (67.300) | 834 |
| NGF | (368) | 296 | (72) |
| SCX | 1.995 | (2.180) | (185) |
| SOG | (1.154) | 1.270 | 116 |
| UAG | 53.696 | (55.060) | (1.364) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(r) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 132,79 | 106,63 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,23) | 0,08 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | 0,94 | (0,72) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 8,18 | 4,54 |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (13,09) | (20,62) |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## Unconstrained Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 118.843.538 | $ 1.189.245 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | $ | 410.800 | 416.015 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 221.300 | 219.361 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 162.192 | 159.424 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | | 150.000 | 151.219 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 148.529 | 147.997 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | | 89.800 | 106.251 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 68.904 | 82.064 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | | 8.024.072 | 80.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 31.10.2022 | $ | 71.600 | 71.022 |
| Japan Treasury Bills | | | |
| (0,035)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 8.270.000 | 69.324 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | | | |
| 10,000 % fällig am 01.01.2025 | BRL | 237.500 | 68.397 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | $ | 60.950 | 62.524 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 59.000 | 59.163 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | | 58.695 | 58.388 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 30.11.2021 | | 51.900 | 51.479 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 43.100 | 42.663 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2015 | | 39.400 | 39.399 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 | € | 25.050 | 33.837 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 4,750 % fällig am 01.09.2044 | | 21.200 | 33.291 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 125.328.719 | $ 1.254.140 |
| | | **PARI (000S)** | |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | $ | 326.300 | 330.797 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2015 | BRL | 797.400 | 246.927 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ | 221.300 | 220.051 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 158.869 | 154.764 |
| US Treasury Notes | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 150.000 | 149.156 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 112.213 | 133.109 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (b) | | 116.856 | 117.308 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | BRL | 454.300 | 116.074 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | |
| 2,500 % fällig am 01.12.2024 | € | 89.800 | 104.212 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2017 | BRL | 420.400 | 97.401 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 89.131 | 86.806 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 843.000 | 84.907 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b) | $ | 81.508 | 80.701 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO US Short-Term Fund (a) | | 8.049.661 | 80.175 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Japan Treasury Bills | | | |
| (0,035)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 8.270.000 | 68.952 |
| US Treasury Notes | | | |
| 1,875 % fällig am 30.11.2021 | $ | 51.900 | 51.466 |
| JPMorgan Chase & Co. | | | |
| 1,027 % fällig am 26.02.2016 | | 46.500 | 46.628 |
| US Treasury Bonds | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 40.200 | 41.156 |
| Federal Home Loan Bank | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2015 | | 39.400 | 39.399 |

(a) Der Unconstrained Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | | |
| **Sequa Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 19.06.2017 | $ | 1.960 | $ 1.362 | 0,07 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN & FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 6.500 | 6.622 | 0,33 |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.08.2022 | | 2.000 | 1.910 | 0,10 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.03.2025 | | 3.000 | 2.970 | 0,15 |
| 5,125 % fällig am 30.09.2024 | | 6.000 | 6.165 | 0,31 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 5.986 | 6.787 | 0,34 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 4.016 | 4.588 | 0,23 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 934 | 1.102 | 0,06 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 29.12.2049 | € | 3.000 | 3.194 | 0,16 |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 3.000 | 3.206 | 0,16 |
| **Banco Popular Espanol S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 29.04.2049 | | 3.000 | 3.072 | 0,15 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2049 | | 5.000 | 5.904 | 0,30 |
| 8,250 % fällig am 29.12.2049 | $ | 1.150 | 1.228 | 0,06 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.12.2049 | | 4.500 | 4.624 | 0,23 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 10.000 | 10.294 | 0,52 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 3.000 | 3.052 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 1.500 | 1.552 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2019 | | 3.000 | 3.142 | 0,16 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.04.2049 | € | 2.500 | 2.797 | 0,14 |
| 7,875 % fällig am 29.01.2049 | $ | 13.450 | 13.796 | 0,70 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 29.12.2049 | | 5.500 | 5.513 | 0,28 |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 1.500 | 1.581 | 0,08 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.04.2022 | | 1.000 | 1.040 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2023 | | 2.000 | 2.110 | 0,11 |
| **Denali Borrower LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2020 | | 5.000 | 5.250 | 0,26 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2026 | | 1.000 | 1.032 | 0,05 |
| **ESH Hospitality, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.05.2025 | | 2.000 | 1.960 | 0,10 |
| **Greystar Real Estate Partners LLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.12.2022 | | 2.000 | 2.085 | 0,10 |
| **HUB International Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.10.2021 | | 5.000 | 4.512 | 0,23 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 2.000 | 2.135 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 2.000 | 2.370 | 0,12 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,700 % fällig am 29.12.2049 | | 3.000 | 3.061 | 0,15 |
| **iStar, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2019 | | 3.000 | 2.925 | 0,15 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2022 | | 2.000 | 1.690 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 01.04.2020 | | 3.000 | 2.677 | 0,13 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | £ | 2.792 | 4.192 | 0,21 |
| 7,500 % fällig am 30.04.2049 | $ | 3.000 | 3.202 | 0,16 |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 8.398 | 12.995 | 0,65 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.06.2019 | $ | 3.000 | 2.768 | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 1.500 | 1.320 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 25.10.2024 | | 5.500 | 4.421 | 0,22 |
| 6,125 % fällig am 25.03.2024 | | 5.000 | 4.094 | 0,21 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 1.000 | 991 | 0,05 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 2.000 | 2.110 | 0,11 |
| **Nordea Bank AB** | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.12.2049 | | 3.000 | 2.941 | 0,15 |
| **OneMain Financial Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2019 | $ | 1.000 | $ 1.016 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 15.12.2021 | | 5.000 | 5.025 | 0,25 |
| **PHH Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2021 | | 2.500 | 2.288 | 0,12 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.06.2021 | | 1.500 | 1.459 | 0,07 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 2.000 | 1.913 | 0,10 |
| **RHP Hotel Properties LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2023 | | 2.000 | 2.010 | 0,10 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 29.12.2049 | | 5.000 | 5.219 | 0,26 |
| 7,648 % fällig am 29.08.2049 | | 3.000 | 3.731 | 0,19 |
| **Selectica, Inc.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.11.2015 (b) | | 6.850 | 0 | 0,00 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.10.2049 | | 2.500 | 2.370 | 0,12 |
| 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 3.500 | 3.496 | 0,18 |
| **UBS Group AG** | | | | |
| 7,000 % fällig am 29.12.2049 | | 2.000 | 2.120 | 0,11 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 03.04.2049 | | 4.000 | 3.796 | 0,19 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | | 5.500 | 5.363 | 0,27 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | £ | 1.148 | 1.755 | 0,09 |
| **Wayne Merger Sub LLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | $ | 4.500 | 4.241 | 0,21 |
| **York Risk Services Holding Corp.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.10.2022 | | 1.625 | 1.339 | 0,07 |
| | | | 212.121 | 10,69 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Accudyne Industries Borrower** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2020 | | 9.250 | 6.706 | 0,34 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2021 | | 1.500 | 1.575 | 0,08 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2023 | | 3.000 | 3.187 | 0,16 |
| **ADS Waste Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.10.2020 | | 5.000 | 5.062 | 0,26 |
| **ADT Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 10.000 | 9.000 | 0,45 |
| 4,125 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | 4.700 | 0,24 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2042 | | 2.125 | 1.530 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2021 | | 1.000 | 1.050 | 0,05 |
| **AECOM** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2022 | | 1.000 | 1.034 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.10.2024 | | 2.500 | 2.559 | 0,13 |
| **Aguila 3 S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 31.01.2018 | CHF | 1.000 | 1.024 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 31.01.2018 | $ | 4.000 | 4.025 | 0,20 |
| **Air Medical Merger Sub Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2023 | | 7.250 | 6.489 | 0,33 |
| **Albea Beauty Holdings S.A.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.11.2019 | | 1.500 | 1.567 | 0,08 |
| **Alere, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.07.2023 | | 7.000 | 6.562 | 0,33 |
| **Aleris International, Inc.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2018 | | 2.500 | 2.137 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 01.11.2020 | | 2.200 | 1.687 | 0,09 |
| **Algeco Scotsman Global Finance PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.10.2018 | | 4.500 | 3.791 | 0,19 |
| **Allegion PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2023 | | 1.500 | 1.534 | 0,08 |
| **Allegion US Holding Co., Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2021 | | 1.000 | 1.017 | 0,05 |
| **Alphabet Holding Co., Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.11.2017 (a) | | 6.100 | 5.963 | 0,30 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | | 5.000 | 4.962 | 0,25 |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 7.500 | 7.425 | 0,37 |
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 2.750 | 2.551 | 0,13 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 5.000 | 4.325 | 0,22 |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 9.500 | 8.597 | 0,43 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2022 | $ | 2.000 | $ 2.007 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.07.2021 | | 1.750 | 1.846 | 0,09 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2021 | | 3.750 | 3.816 | 0,19 |
| 5,750 % fällig am 15.12.2023 | | 2.000 | 2.020 | 0,10 |
| **Amsted Industries, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 5.025 | 0,25 |
| **Ancestry.com Holdings LLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.10.2018 (a) | | 5.000 | 4.944 | 0,25 |
| **Antero Resources Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2022 | | 3.000 | 2.295 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 01.11.2021 | | 1.500 | 1.207 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 01.06.2023 | | 2.000 | 1.570 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2020 | | 1.000 | 840 | 0,04 |
| **Argos Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.03.2023 | | 7.000 | 6.958 | 0,35 |
| **Ashland, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.08.2022 | | 3.000 | 2.929 | 0,15 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2043 | | 3.000 | 2.865 | 0,14 |
| **Associated Materials LLC** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.11.2017 | | 6.000 | 4.170 | 0,21 |
| **Axiall Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | | 2.000 | 1.807 | 0,09 |
| **B&G Foods, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2021 | | 3.000 | 2.981 | 0,15 |
| **Ball Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.07.2025 | | 2.000 | 2.052 | 0,10 |
| **Baytex Energy Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.06.2021 | | 1.000 | 677 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 01.06.2024 | | 1.500 | 1.012 | 0,05 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.10.2023 | | 3.000 | 3.071 | 0,15 |
| **Belden, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2024 | | 1.000 | 925 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 1.000 | 967 | 0,05 |
| **Berry Plastics Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2022 | | 3.000 | 3.067 | 0,15 |
| **Beverage Packaging Holdings Luxembourg II S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.12.2016 | | 1.000 | 991 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2017 | | 1.000 | 971 | 0,05 |
| **Blue Coat Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,375 % fällig am 01.06.2023 | | 6.500 | 6.565 | 0,33 |
| **BlueLine Rental Finance Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.02.2019 | | 2.900 | 2.624 | 0,13 |
| **BMC Software Finance, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.07.2021 | | 6.750 | 4.514 | 0,23 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 3.125 | 2.203 | 0,11 |
| **Boxer Parent Co., Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.10.2019 (a) | | 2.500 | 1.559 | 0,08 |
| **Boyd Gaming Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.05.2023 | | 6.000 | 6.195 | 0,31 |
| **Bristow Group, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 1.000 | 786 | 0,04 |
| **Building Materials Corporation of America** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 5.000 | 5.012 | 0,25 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2025 | | 3.500 | 3.587 | 0,18 |
| **Cablevision Systems Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 4.000 | 3.410 | 0,17 |
| **Caesars Entertainment Operating Co., Inc. (b)** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.02.2020 | | 500 | 382 | 0,02 |
| 9,000 % fällig am 15.02.2020 | | 2.125 | 1.626 | 0,08 |
| **CalAtlantic Group, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2022 | | 1.000 | 1.010 | 0,05 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2021 | | 919 | 294 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2024 | | 1.379 | 424 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 6.160 | 3.257 | 0,16 |
| **Capsugel S.A.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2019 (a) | | 5.000 | 4.884 | 0,25 |
| **Carrizo Oil & Gas, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.04.2023 | | 1.500 | 1.222 | 0,06 |
| **Case New Holland Industrial, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.12.2017 | | 1.500 | 1.594 | 0,08 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2023 | $ | 6.000 | $ 6.022 | 0,30 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 4.010 | 0,20 |
| 5,250 % fällig am 30.09.2022 | | 7.000 | 7.087 | 0,36 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2023 | | 2.000 | 2.055 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 1.500 | 1.545 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2027 | | 1.250 | 1.247 | 0,06 |
| **CCOH Safari LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.02.2026 | | 6.250 | 6.281 | 0,32 |
| **Central Garden & Pet Co.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 1.750 | 1.776 | 0,09 |
| **Cequel Communications Holdings I LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2021 | | 5.000 | 4.519 | 0,23 |
| 6,375 % fällig am 15.09.2020 | | 3.000 | 2.944 | 0,15 |
| **CeramTec Group GmbH** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.08.2021 | € | 3.500 | 4.102 | 0,21 |
| **CHC Helicopter S.A.** | | | | |
| 9,250 % fällig am 15.10.2020 | $ | 5.648 | 2.739 | 0,14 |
| **Chemours Co.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2023 | | 4.000 | 2.820 | 0,14 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2025 | | 2.000 | 1.370 | 0,07 |
| **Chemtura Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2021 | | 2.500 | 2.525 | 0,13 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 5.710 | 2.826 | 0,14 |
| **Chinos Intermediate Holdings A, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.05.2019 (a) | | 2.500 | 637 | 0,03 |
| **Clear Channel Communications, Inc.** | | | | |
| 14,000 % fällig am 01.02.2021 (a) | | 802 | 223 | 0,01 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 4.000 | 3.875 | 0,20 |
| 7,625 % fällig am 15.03.2020 | | 5.000 | 4.637 | 0,23 |
| **Clearwater Paper Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 2.500 | 2.425 | 0,12 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2019 | | 2.000 | 1.895 | 0,10 |
| **Coeur Mining, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2021 | | 1.000 | 602 | 0,03 |
| **Columbus International, Inc.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 30.03.2021 | | 2.500 | 2.484 | 0,13 |
| **CommScope Technologies Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.750 | 1.689 | 0,09 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2021 | | 3.000 | 2.887 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.06.2024 | | 3.500 | 3.338 | 0,17 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 3.000 | 3.000 | 0,15 |
| 6,875 % fällig am 01.02.2022 | | 10.000 | 9.537 | 0,48 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2020 | | 1.500 | 1.502 | 0,08 |
| **Concho Resources, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2022 | | 2.000 | 1.830 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2023 | | 3.750 | 3.487 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2022 | | 2.500 | 2.412 | 0,12 |
| **Concordia Healthcare Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.04.2023 | | 5.000 | 4.362 | 0,22 |
| 9,500 % fällig am 21.10.2022 | | 5.000 | 4.950 | 0,25 |
| **Consol Energy, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2022 | | 2.500 | 1.562 | 0,08 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.05.2023 | | 1.000 | 1.002 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 01.12.2025 | | 2.000 | 2.042 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2022 | | 1.500 | 1.654 | 0,08 |
| **Constellium NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 2.500 | 1.712 | 0,09 |
| **ConvaTec Finance International S.A.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.01.2019 (a) | | 8.000 | 7.470 | 0,38 |
| **ConvaTec Healthcare E S.A.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 15.12.2018 | | 3.000 | 3.031 | 0,15 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2024 | | 2.025 | 1.843 | 0,09 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2022 | | 1.000 | 1.000 | 0,05 |
| **CPG Merger Sub LLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.10.2021 | | 12.500 | 12.312 | 0,62 |
| **Crimson Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 22.000 | 15.125 | 0,76 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2023 | | 1.000 | 982 | 0,05 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2024 | $ | 6.000 | $ 5.280 | 0,27 |
| 8,625 % fällig am 15.02.2019 | | 1.000 | 1.067 | 0,05 |
| **Darling Ingredients, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2022 | | 4.250 | 4.202 | 0,21 |
| **DaVita HealthCare Partners, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2025 | | 4.000 | 3.870 | 0,20 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2024 | | 5.000 | 5.009 | 0,25 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2022 | | 2.000 | 2.067 | 0,10 |
| **DBP Holding Corp.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2020 | | 3.000 | 1.680 | 0,08 |
| **Dean Foods Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2023 | | 3.000 | 3.127 | 0,16 |
| **Dell, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2038 | | 750 | 619 | 0,03 |
| **Denbury Resources, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2023 | | 2.000 | 654 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2022 | | 1.000 | 337 | 0,02 |
| **Diamond Foods, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2019 | | 2.500 | 2.587 | 0,13 |
| **Digicel Group Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.04.2022 | | 4.250 | 3.209 | 0,16 |
| 8,250 % fällig am 30.09.2020 | | 4.750 | 3.942 | 0,20 |
| **Digicel Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | | 2.500 | 2.119 | 0,11 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 6.000 | 5.220 | 0,26 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 2.000 | 1.985 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 3.000 | 2.805 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 3.625 | 3.235 | 0,16 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 2.500 | 2.525 | 0,13 |
| **DJO Finance LLC** | | | | |
| 10,750 % fällig am 15.04.2020 | | 1.000 | 910 | 0,05 |
| **DJO Finco, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.06.2021 | | 10.000 | 8.900 | 0,45 |
| **Dollar Tree, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2020 | | 1.250 | 1.297 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2023 | | 3.500 | 3.640 | 0,18 |
| **DR Horton, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 2.000 | 1.997 | 0,10 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | | 1.375 | 1.231 | 0,06 |
| **Eagle Spinco, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | | 3.000 | 2.771 | 0,14 |
| **Eldorado Resorts, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.08.2023 | | 3.750 | 3.694 | 0,19 |
| **Endo Finance LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2022 | | 3.500 | 3.412 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 15.01.2023 | | 4.250 | 4.186 | 0,21 |
| **Endo Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2023 | | 6.000 | 6.000 | 0,30 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2025 | | 7.000 | 6.930 | 0,35 |
| **Ensemble S Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 30.09.2023 | | 5.500 | 5.335 | 0,27 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2022 | | 3.000 | 2.955 | 0,15 |
| **Era Group, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2022 | | 1.750 | 1.435 | 0,07 |
| **ExamWorks Group, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 625 | 624 | 0,03 |
| **Fiat Chrysler Automobiles NV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 2.000 | 1.975 | 0,10 |
| **First Data Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 5.000 | 4.937 | 0,25 |
| 6,750 % fällig am 01.11.2020 | | 2.597 | 2.730 | 0,14 |
| 7,000 % fällig am 01.12.2023 | | 8.000 | 8.020 | 0,40 |
| **First Quality Finance Co., Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2021 | | 4.000 | 3.660 | 0,18 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.02.2020 | | 2.747 | 1.786 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 15.02.2021 | | 3.500 | 2.214 | 0,11 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 2.250 | 1.417 | 0,07 |
| **FMG Resources August 2006 Pty Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2022 | | 1.517 | 941 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 01.11.2019 | | 1.000 | 797 | 0,04 |
| **Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2020 | | 1.000 | 1.015 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 15.10.2024 | $ | 2.000 | $ 1.960 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 1.000 | 1.081 | 0,05 |
| **Gardner Denver, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2021 | | 20.000 | 15.400 | 0,78 |
| **Gates Global LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | | 7.000 | 5.075 | 0,26 |
| **GCI, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2025 | | 1.000 | 1.027 | 0,05 |
| **General Cable Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2022 | | 2.500 | 1.937 | 0,10 |
| **Getty Images, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.10.2020 | | 5.750 | 2.099 | 0,11 |
| **Greatbatch Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.11.2023 | | 4.000 | 3.970 | 0,20 |
| **Grifols Worldwide Operations Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.04.2022 | | 5.000 | 5.037 | 0,25 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | | 3.562 | 2.992 | 0,15 |
| 7,750 % fällig am 01.11.2020 | | 2.000 | 1.800 | 0,09 |
| **Halcon Resources Corp.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 01.02.2020 | | 1.500 | 1.041 | 0,05 |
| 12,000 % fällig am 15.02.2022 | | 2.340 | 1.550 | 0,08 |
| **HCA Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2021 | | 6.500 | 6.906 | 0,35 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 5.000 | 4.962 | 0,25 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 5.000 | 5.000 | 0,25 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 2.500 | 2.472 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 3.000 | 3.172 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 4.120 | 0,21 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 7.000 | 7.787 | 0,39 |
| **HD Supply, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.12.2021 | | 2.000 | 2.047 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 15.07.2020 | | 8.000 | 8.360 | 0,42 |
| **Hearthside Group Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2022 | | 8.000 | 7.440 | 0,38 |
| **Hertz Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2020 | | 2.500 | 2.591 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 1.000 | 1.040 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 15.01.2021 | | 2.250 | 2.346 | 0,12 |
| **Hexion, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.04.2020 | | 5.000 | 3.912 | 0,20 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2021 | | 4.000 | 4.165 | 0,21 |
| **Horizon Pharma Financing, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | | 3.000 | 2.685 | 0,14 |
| **Hughes Satellite Systems Corp.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.06.2021 | | 2.500 | 2.659 | 0,13 |
| **Huntington Ingalls Industries, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 1.250 | 1.278 | 0,06 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.11.2020 | | 2.000 | 1.835 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2022 | | 2.500 | 2.263 | 0,11 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | | 9.000 | 6.311 | 0,32 |
| 10,000 % fällig am 15.01.2018 | | 250 | 96 | 0,01 |
| **INEOS Group Holdings S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2018 | | 4.000 | 3.975 | 0,20 |
| **Informatica LLC** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.07.2023 | | 7.000 | 6.370 | 0,32 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | | 5.250 | 4.148 | 0,21 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2022 | | 7.750 | 4.979 | 0,25 |
| 7,250 % fällig am 15.10.2020 | | 2.000 | 1.760 | 0,09 |
| **Intelsat Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.06.2021 | | 2.200 | 1.040 | 0,05 |
| 8,125 % fällig am 01.06.2023 | | 3.250 | 1.487 | 0,08 |
| **International Game Technology PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2022 | | 3.000 | 2.820 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2025 | | 4.000 | 3.530 | 0,18 |
| **Jaguar Holding Co. II** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.08.2023 | | 5.000 | 4.888 | 0,25 |
| **JMC Steel Group, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.03.2018 | | 2.750 | 1.844 | 0,09 |
| **Jo-Ann Stores, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.03.2019 | | 1.500 | 1.208 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | |
| 10,500 % fällig am 01.11.2018 | $ 5.000 | $ 4.888 | 0,25 |
| 12,500 % fällig am 01.11.2019 | 8.000 | 7.300 | 0,37 |
| **KLX, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2022 | 7.000 | 6.685 | 0,34 |
| **L Brands, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.02.2022 | 2.000 | 2.128 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2021 | 2.250 | 2.503 | 0,13 |
| **Lamar Media Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2023 | 1.500 | 1.526 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2022 | 1.000 | 1.055 | 0,05 |
| **Land O'Lakes, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | 2.000 | 2.100 | 0,11 |
| **Laredo Petroleum, Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2023 | 3.000 | 2.625 | 0,13 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2022 | 1.500 | 1.388 | 0,07 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | 1.500 | 1.494 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2024 | 2.000 | 2.015 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | 4.000 | 3.995 | 0,20 |
| **LifePoint Health, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.12.2021 | 2.000 | 2.040 | 0,10 |
| 5,875 % fällig am 01.12.2023 | 1.500 | 1.526 | 0,08 |
| **LIN Television Corp.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2022 | 2.000 | 1.995 | 0,10 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 01.09.2020 | 2.000 | 2.080 | 0,11 |
| **LKQ Corp.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.05.2023 | 3.000 | 2.828 | 0,14 |
| **LTF Merger Sub, Inc.** | | | |
| 8,500 % fällig am 15.06.2023 | 3.000 | 2.880 | 0,15 |
| **Lundin Mining Corp.** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.11.2020 | 3.000 | 2.820 | 0,14 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.04.2023 | 6.000 | 5.340 | 0,27 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2025 | 2.000 | 1.850 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2023 | 2.000 | 1.910 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 01.08.2022 | 5.500 | 5.308 | 0,27 |
| **Manitowoc Co., Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.10.2022 | 3.000 | 3.113 | 0,16 |
| **Masonite International Corp.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | 1.500 | 1.556 | 0,08 |
| **Matador Resources Co.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.04.2023 | 2.500 | 2.338 | 0,12 |
| **MCE Finance Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | 5.000 | 4.575 | 0,23 |
| **MEDNAX, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2023 | 2.000 | 2.015 | 0,10 |
| **MGM Resorts International** | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | 4.000 | 3.980 | 0,20 |
| 6,000 % fällig am 15.03.2023 | 8.000 | 7.960 | 0,40 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | 5.000 | 5.144 | 0,26 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | 7.500 | 7.744 | 0,39 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | 3.750 | 3.998 | 0,20 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 01.04.2022 | 6.500 | 6.533 | 0,33 |
| **MPLX LP** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.07.2023 | 3.500 | 3.149 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 01.12.2024 | 2.000 | 1.805 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2023 | 1.000 | 880 | 0,04 |
| **MSCI, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2024 | 1.000 | 1.018 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | 1.500 | 1.541 | 0,08 |
| **Multi-Color Corp.** | | | |
| 6,125 % fällig am 01.12.2022 | 2.000 | 1.990 | 0,10 |
| **Murphy Oil USA, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2023 | 2.500 | 2.638 | 0,13 |
| **NBTY, Inc.** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.10.2018 | 1.000 | 1.015 | 0,05 |
| **NCR Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | 1.000 | 956 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2022 | 3.250 | 3.165 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 15.12.2021 | 1.000 | 989 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2023 | 1.000 | 989 | 0,05 |
| **Neiman Marcus Group Ltd. LLC** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.10.2021 (a) | 3.000 | 1.875 | 0,09 |
| **Neptune Finco Corp.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.10.2025 | $ 2.000 | $ 2.085 | 0,11 |
| 10,125 % fällig am 15.01.2023 | 2.500 | 2.613 | 0,13 |
| **NeuStar, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2023 | 1.000 | 806 | 0,04 |
| **New Red Finance, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.04.2022 | 6.000 | 6.195 | 0,31 |
| **Nexteer Automotive Group Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2021 | 1.000 | 1.025 | 0,05 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2022 | 3.625 | 3.593 | 0,18 |
| **Novelis, Inc.** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.12.2020 | 5.000 | 4.613 | 0,23 |
| **Numericable-SFR SAS** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2019 | 2.000 | 1.988 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2022 | 7.500 | 7.294 | 0,37 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | 8.000 | 7.740 | 0,39 |
| **NXP BV** | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2020 | 1.500 | 1.504 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 15.03.2023 | 3.000 | 3.105 | 0,16 |
| **Oasis Petroleum, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.11.2021 | 1.500 | 1.001 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2022 | 2.000 | 1.290 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.01.2023 | 1.750 | 1.094 | 0,06 |
| **Omega US Sub LLC** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.07.2023 | 3.000 | 2.783 | 0,14 |
| **Oshkosh Corp.** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.03.2025 | 1.000 | 985 | 0,05 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2022 | 2.000 | 2.052 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 15.02.2024 | 1.500 | 1.547 | 0,08 |
| **Pactiv LLC** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.04.2027 | 500 | 468 | 0,02 |
| **Party City Holdings, Inc.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2023 | 3.000 | 2.925 | 0,15 |
| **Peabody Energy Corp.** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.11.2021 | 2.000 | 285 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 01.11.2026 | 1.000 | 143 | 0,01 |
| **Penn National Gaming, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | 2.500 | 2.438 | 0,12 |
| **Perstorp Holding AB** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.05.2017 | 5.000 | 4.975 | 0,25 |
| 11,000 % fällig am 15.08.2017 | 3.000 | 2.835 | 0,14 |
| **Petco Animal Supplies, Inc.** | | | |
| 9,250 % fällig am 01.12.2018 | 2.000 | 2.055 | 0,10 |
| **Petco Holdings, Inc.** | | | |
| 8,500 % fällig am 15.10.2017 (a) | 6.000 | 6.113 | 0,31 |
| **PHI, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.03.2019 | 1.000 | 805 | 0,04 |
| **Pilgrim's Pride Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2025 | 4.000 | 3.900 | 0,20 |
| **Pinnacle Entertainment, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 01.08.2021 | 3.000 | 3.169 | 0,16 |
| **Pinnacle Foods Finance LLC** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2021 | 5.000 | 4.813 | 0,24 |
| **Pinnacle Operating Corp.** | | | |
| 9,000 % fällig am 15.11.2020 | 750 | 707 | 0,04 |
| **Platform Specialty Products Corp.** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2022 | 9.000 | 7.830 | 0,39 |
| 10,375 % fällig am 01.05.2021 | 2.325 | 2.325 | 0,12 |
| **Ply Gem Industries, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2022 | 12.500 | 11.484 | 0,58 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.12.2022 | 4.000 | 3.935 | 0,20 |
| 6,750 % fällig am 01.12.2021 | 6.750 | 6.902 | 0,35 |
| 7,375 % fällig am 15.02.2022 | 4.000 | 4.185 | 0,21 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2024 | 1.000 | 1.050 | 0,05 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2025 | 1.750 | 1.859 | 0,09 |
| **PRA Holdings, Inc.** | | | |
| 9,500 % fällig am 01.10.2023 | 5.000 | 5.463 | 0,28 |
| **Precision Drilling Corp.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2024 | 1.000 | 685 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2020 | 3.000 | 2.355 | 0,12 |
| **Prestige Brands, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.12.2021 | 6.000 | 5.790 | 0,29 |
| 8,125 % fällig am 01.02.2020 | 1.000 | 1.040 | 0,05 |
| **PVH Corp.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.12.2022 | $ 3.250 | $ 3.193 | 0,16 |
| **Qorvo, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 01.12.2023 | 2.000 | 2.045 | 0,10 |
| 7,000 % fällig am 01.12.2025 | 2.250 | 2.323 | 0,12 |
| **Range Resources Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2025 | 2.000 | 1.528 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | 2.500 | 1.881 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | 4.000 | 3.000 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2021 | 1.000 | 795 | 0,04 |
| **Regency Energy Partners LP** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2023 | 2.850 | 2.470 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | 2.750 | 2.480 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | 3.000 | 2.831 | 0,14 |
| **Reynolds Group Issuer, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.10.2020 | 5.000 | 5.098 | 0,26 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | 3.000 | 3.098 | 0,16 |
| 8,250 % fällig am 15.02.2021 | 8.500 | 8.224 | 0,41 |
| **Rice Energy, Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 01.05.2022 | 2.000 | 1.450 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 01.05.2023 | 2.000 | 1.470 | 0,07 |
| **Rite Aid Corp.** | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2023 | 6.200 | 6.440 | 0,32 |
| **Riverbed Technology, Inc.** | | | |
| 8,875 % fällig am 01.03.2023 | 2.500 | 2.322 | 0,12 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | 4.000 | 3.700 | 0,19 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2019 | 1.000 | 955 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 15.04.2040 | 1.000 | 865 | 0,04 |
| **RSI Home Products, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2023 | 2.000 | 2.070 | 0,10 |
| **Sable International Finance Ltd.** | | | |
| 8,750 % fällig am 01.02.2020 | 2.000 | 2.105 | 0,11 |
| **Sally Holdings LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.12.2025 | 4.000 | 4.060 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2022 | 2.000 | 2.080 | 0,11 |
| **Sanchez Energy Corp.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2023 | 4.000 | 2.180 | 0,11 |
| **SandRidge Energy, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.03.2021 | 1.500 | 165 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2023 | 1.000 | 114 | 0,01 |
| 8,125 % fällig am 15.10.2022 | 1.000 | 115 | 0,01 |
| **SBA Communications Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2022 | 2.000 | 1.978 | 0,10 |
| **SBA Telecommunications, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2020 | 1.500 | 1.566 | 0,08 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2021 | 5.000 | 4.988 | 0,25 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2021 | 4.000 | 4.040 | 0,20 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2023 | 2.500 | 2.463 | 0,12 |
| **Schaeffler Holding Finance BV (a)** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.11.2019 | 2.625 | 2.753 | 0,14 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 | 6.000 | 6.480 | 0,33 |
| 6,875 % fällig am 15.08.2018 | 4.000 | 4.130 | 0,21 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 01.09.2020 | 1.500 | 713 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 01.01.2022 | 2.000 | 1.920 | 0,10 |
| 10,000 % fällig am 01.12.2022 | 3.625 | 2.592 | 0,13 |
| **Scotts Miracle-Gro Co.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2023 | 2.250 | 2.357 | 0,12 |
| **Sealed Air Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2022 | 750 | 755 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 01.12.2024 | 2.500 | 2.513 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 01.04.2023 | 3.500 | 3.588 | 0,18 |
| **Sensata Technologies BV** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2023 | 2.000 | 1.953 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | 1.500 | 1.470 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 01.11.2024 | 2.000 | 2.053 | 0,10 |
| **Sensata Technologies UK Financing Co. PLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | 4.000 | 4.170 | 0,21 |
| **Sequa Corp.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.12.2017 | 3.500 | 1.129 | 0,06 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | |
| 8,125 % fällig am 01.10.2020 | 4.000 | 4.200 | 0,21 |
| **ServiceMaster Co. LLC** | | | |
| 7,450 % fällig am 15.08.2027 | 4.830 | 4.830 | 0,24 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Seventy Seven Operating LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.11.2019 | $ | 3.000 | $ 1.065 | 0,05 |
| **SIG Combibloc Holdings SCA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 6.000 | 6.827 | 0,34 |
| **Signode Industrial Group Lux S.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2022 | $ | 10.000 | 8.550 | 0,43 |
| **Simmons Foods, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.10.2021 | | 4.000 | 3.630 | 0,18 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2025 | | 3.000 | 3.026 | 0,15 |
| **SiTV LLC** | | | | |
| 10,375 % fällig am 01.07.2019 | | 1.000 | 805 | 0,04 |
| **Smithfield Foods, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.08.2021 | | 1.250 | 1.291 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 15.08.2022 | | 5.000 | 5.206 | 0,26 |
| **Smurfit Kappa Treasury Funding Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 20.11.2025 | | 500 | 579 | 0,03 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | | 5.000 | 5.150 | 0,26 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2024 | | 1.500 | 1.568 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2022 | | 5.500 | 5.830 | 0,29 |
| **Springs Industries, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.06.2021 | | 4.500 | 4.478 | 0,23 |
| **SPX FLOW, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.09.2017 | | 1.000 | 1.068 | 0,05 |
| **Station Casinos LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.03.2021 | | 2.500 | 2.563 | 0,13 |
| **Steel Dynamics, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2021 | | 2.500 | 2.325 | 0,12 |
| 6,375 % fällig am 15.08.2022 | | 750 | 724 | 0,04 |
| **Sterigenics-Nordion Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | 4.788 | 0,24 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2020 | | 3.000 | 2.910 | 0,15 |
| **Suburban Propane Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2025 | | 1.500 | 1.230 | 0,06 |
| **Sun Products Corp.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2021 | | 14.000 | 12.215 | 0,62 |
| **Sunoco LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2020 | | 5.000 | 4.763 | 0,24 |
| **TEGNA, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.09.2021 | | 750 | 754 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | | 1.500 | 1.504 | 0,08 |
| **Teine Energy Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.09.2022 | | 2.250 | 1.823 | 0,09 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2021 | | 3.000 | 2.910 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2021 | | 6.000 | 5.880 | 0,30 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2019 | | 4.000 | 3.710 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2019 | | 250 | 237 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 7.500 | 6.970 | 0,35 |
| 8,125 % fällig am 01.04.2022 | | 2.500 | 2.506 | 0,13 |
| **Terex Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2021 | | 2.300 | 2.128 | 0,11 |
| **Tesoro Logistics LP** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.10.2022 | | 4.000 | 3.810 | 0,19 |
| **Time, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.04.2022 | | 1.500 | 1.376 | 0,07 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2023 | | 2.000 | 2.030 | 0,10 |
| 6,250 % fällig am 01.04.2021 | | 3.000 | 3.098 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2025 | | 4.000 | 4.060 | 0,20 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2026 | | 3.500 | 3.542 | 0,18 |
| 6,625 % fällig am 01.04.2023 | | 5.500 | 5.624 | 0,28 |
| 6,731 % fällig am 28.04.2022 | | 4.000 | 4.180 | 0,21 |
| 6,836 % fällig am 28.04.2023 | | 2.500 | 2.594 | 0,13 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2020 | | 4.750 | 4.619 | 0,23 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | | 8.000 | 7.860 | 0,40 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2024 | | 8.000 | 7.996 | 0,40 |
| 6,500 % fällig am 15.05.2025 | | 4.000 | 3.890 | 0,20 |
| **TreeHouse Foods, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2022 | | 3.000 | 2.865 | 0,14 |
| **Triangle USA Petroleum Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2022 | | 375 | 116 | 0,01 |
| **Tribune Media Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 3.000 | 3.008 | 0,15 |
| **Tronox Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.08.2020 | $ | 2.000 | $ 1.214 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2022 | | 2.000 | 1.165 | 0,06 |
| **Tullow Oil PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.04.2022 | | 1.500 | 1.013 | 0,05 |
| **United Rentals North America, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.07.2025 | | 2.000 | 1.948 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2023 | | 1.000 | 1.028 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 15.05.2020 | | 1.250 | 1.322 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 15.04.2022 | | 1.500 | 1.611 | 0,08 |
| 8,250 % fällig am 01.02.2021 | | 920 | 967 | 0,05 |
| **Unitymedia GmbH** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2025 | | 4.000 | 3.968 | 0,20 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2025 | | 3.000 | 2.876 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 5.000 | 5.006 | 0,25 |
| **Univar USA, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2023 | | 4.000 | 3.660 | 0,18 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 5.375 | 5.200 | 0,26 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 9.000 | 8.573 | 0,43 |
| 6,750 % fällig am 15.09.2022 | | 3.154 | 3.280 | 0,17 |
| **UPCB Finance IV Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | | 6.000 | 5.685 | 0,29 |
| **UPCB Finance V Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.11.2021 | | 1.575 | 1.679 | 0,08 |
| **UPCB Finance VI Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2022 | | 2.250 | 2.388 | 0,12 |
| **US Foods, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 30.06.2019 | | 3.000 | 3.098 | 0,16 |
| **USG Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 1.500 | 1.528 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | | 2.000 | 2.090 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 30.03.2020 | | 1.000 | 1.053 | 0,05 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 | | 6.000 | 5.310 | 0,27 |
| 5,625 % fällig am 01.12.2021 | | 9.050 | 8.371 | 0,42 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | 4.488 | 0,23 |
| 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 7.500 | 6.713 | 0,34 |
| 6,375 % fällig am 15.10.2020 | | 4.750 | 4.608 | 0,23 |
| 6,750 % fällig am 15.08.2021 | | 1.500 | 1.455 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 01.10.2020 | | 3.000 | 3.008 | 0,15 |
| 7,250 % fällig am 15.07.2022 | | 3.250 | 3.193 | 0,16 |
| **Vander Intermediate Holding II Corp.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.02.2019 (a) | | 1.000 | 655 | 0,03 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.05.2023 | | 4.125 | 4.015 | 0,20 |
| **Videotron Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2022 | | 2.500 | 2.509 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.06.2024 | | 1.500 | 1.511 | 0,08 |
| **Welltec** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.02.2019 | | 3.000 | 2.828 | 0,14 |
| **Whiting Petroleum Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2019 | | 1.000 | 760 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.03.2021 | | 3.000 | 2.202 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 01.04.2023 | | 2.000 | 1.450 | 0,07 |
| **Wind Acquisition Finance S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2020 | | 6.500 | 6.451 | 0,33 |
| 7,375 % fällig am 23.04.2021 | | 5.750 | 5.448 | 0,27 |
| **Wise Metals Group LLC** | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.12.2018 | | 2.000 | 1.525 | 0,08 |
| **Wolverine World Wide, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.10.2020 | | 1.000 | 1.045 | 0,05 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | | 2.000 | 1.330 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.08.2020 | | 1.000 | 815 | 0,04 |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | | 1.500 | 1.204 | 0,06 |
| **WR Grace & Co.-Conn** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2021 | | 350 | 354 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2024 | | 1.250 | 1.267 | 0,06 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | | 4.000 | 3.438 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2022 | | 2.500 | 2.379 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 4.250 | 3.804 | 0,19 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2021 | | 2.000 | 1.770 | 0,09 |
| **XPO Logistics, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 6.075 | 5.642 | 0,28 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 4.000 | 4.082 | 0,21 |
| **Zebra Technologies Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.10.2022 | $ | 4.000 | $ 4.190 | 0,21 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 1.000 | 1.012 | 0,05 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 2.000 | 1.963 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | | 5.000 | 4.781 | 0,24 |
| **Ziggo Bond Finance BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2025 | | 3.000 | 2.794 | 0,14 |
| | | | 1.433.601 | 72,27 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AES Corp.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.07.2021 | | 4.000 | 4.100 | 0,21 |
| 8,000 % fällig am 01.06.2020 | | 1.500 | 1.657 | 0,08 |
| **American Energy-Permian Basin LLC** | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.11.2021 | | 250 | 99 | 0,01 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2022 | | 4.000 | 2.780 | 0,14 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2023 | | 6.000 | 5.415 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 4.250 | 3.767 | 0,19 |
| **Dynegy, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.11.2019 | | 3.500 | 3.307 | 0,17 |
| 7,375 % fällig am 01.11.2022 | | 3.125 | 2.734 | 0,14 |
| 7,625 % fällig am 01.11.2024 | | 3.625 | 3.117 | 0,16 |
| **EP Energy LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 01.05.2020 | | 3.000 | 1.927 | 0,10 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2025 | | 4.000 | 3.310 | 0,17 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2019 | | 2.000 | 2.010 | 0,10 |
| 10,500 % fällig am 15.09.2022 | | 1.000 | 999 | 0,05 |
| 11,000 % fällig am 15.09.2025 | | 2.000 | 1.985 | 0,10 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.02.2021 | | 2.500 | 2.125 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 01.08.2022 | | 4.500 | 3.847 | 0,19 |
| **LBC Tank Terminals Holding Netherlands BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.05.2023 | | 2.500 | 2.487 | 0,13 |
| **Midwest Generation LLC** | | | | |
| 8,560 % fällig am 02.01.2016 | | 106 | 105 | 0,01 |
| **Millicom International Cellular S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.10.2021 | | 2.000 | 1.858 | 0,09 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.07.2022 | | 3.250 | 2.785 | 0,14 |
| 6,250 % fällig am 01.05.2024 | | 3.000 | 2.536 | 0,13 |
| 6,625 % fällig am 15.03.2023 | | 4.500 | 3.926 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 15.05.2021 | | 3.250 | 3.063 | 0,15 |
| **NSG Holdings LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | | 3.185 | 3.456 | 0,17 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 5.000 | 4.800 | 0,24 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 1.750 | 1.619 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 4.000 | 3.530 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 7.750 | 6.781 | 0,34 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | | 4.250 | 2.975 | 0,15 |
| 6,900 % fällig am 01.05.2019 | | 2.500 | 2.050 | 0,10 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 7.500 | 5.644 | 0,28 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 8.000 | 5.660 | 0,29 |
| 9,000 % fällig am 15.11.2018 | | 2.250 | 2.374 | 0,12 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 9.000 | 6.536 | 0,33 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 3.500 | 2.650 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 2.000 | 1.470 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 3.750 | 2.826 | 0,14 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2019 | | 5.000 | 3.775 | 0,19 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2025 | | 2.000 | 1.330 | 0,07 |
| **Targa Resources Partners LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.11.2019 | | 1.000 | 838 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 15.11.2023 | | 3.000 | 2.325 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2018 | | 2.000 | 1.860 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 01.05.2023 | | 4.000 | 3.260 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 01.08.2022 | | 748 | 649 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 01.10.2020 | | 1.000 | 908 | 0,05 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | | 1.000 | 960 | 0,05 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | | 2.000 | 2.030 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Telecom Italia SpA** | | | |
| 5,303 % fällig am 30.05.2024 | $ 6.000 | $ 5.948 | 0,30 |
| **Tenaska Alabama Partners LP** | | | |
| 7,000 % fällig am 30.06.2021 | 1.832 | 1.896 | 0,10 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2023 | 4.000 | 3.330 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2025 | 2.000 | 1.620 | 0,08 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | 3.250 | 3.136 | 0,16 |
| 6,375 % fällig am 15.04.2023 | 3.000 | 3.056 | 0,15 |
| | | 149.231 | 7,52 |
| Summe Unternehmensanleihen & Wechsel | | 1.794.953 | 90,48 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | |
| 8,160 % fällig am 30.05.2009 (b) | 20 | 83 | 0,00 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Cook County, Illinois, Finance Authority Sports Facility Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2014 (b) | 550 | 138 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | |
| **Alternative Loan Trust (b)** | | | |
| 0,632 % fällig am 20.05.2046 | $ 159 | $ 122 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | 145 | 128 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,881 % fällig am 20.02.2036 (b) | 356 | 291 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,742 % fällig am 25.03.2035 | 69 | 53 | 0,00 |
| 0,772 % fällig am 25.02.2036 (b) | 64 | 55 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,863 % fällig am 25.02.2037 (b) | 509 | 268 | 0,01 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.01.2037 (b) | 112 | 51 | 0,00 |
| **Deutsche Alternative-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 (b) | 132 | 112 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,993 % fällig am 25.04.2035 | 8 | 8 | 0,00 |
| **IndyMac IMSC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 (b) | 486 | 439 | 0,02 |
| **MortgageIT Trust** | | | |
| 1,062 % fällig am 25.02.2035 | 299 | 293 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.05.2046 (b) | $ 348 | $ 215 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,970 % fällig am 25.09.2036 (b) | 662 | 99 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust (b)** | | | |
| 2,185 % fällig am 25.12.2036 | 515 | 460 | 0,02 |
| 2,431 % fällig am 25.10.2036 | 349 | 314 | 0,02 |
| | | 2.908 | 0,15 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (c)** | | | |
| **PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund** | 14.940.369 | 149.434 | 7,53 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.948.878** | **98,24** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-23 Index | 5,000 % | 20.12.2019 | $ 19.400 | $ (147) | (0,01) |
| CDX.HY-24 Index | 5,000 % | 20.06.2020 | 4.950 | (15) | 0,00 |
| CDX.HY-25 Index | 5,000 % | 20.12.2020 | 20.000 | (346) | (0,02) |
| | | | | $ (508) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ (508)** | **(0,03)** |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ 28.854 | € 26.553 | CBK | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |
| 01/2016 | € 29.144 | $ 31.059 | HUS | 0 | (601) | (601) | (0,03) |
| 01/2016 | $ 2.761 | € 2.603 | JPM | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| 01/2016 | 113 | 104 | RBC | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | £ 9 | $ 13 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ 27 | £ 18 | CBK | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ 12.765 | $ 19.245 | MSB | 431 | 0 | 431 | 0,02 |
| 01/2016 | $ 10 | £ 7 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | 18.888 | 12.765 | UAG | 0 | (73) | (73) | 0,00 |
| 02/2016 | BRL 106 | $ 26 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ 26 | BRL 106 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | CHF 1.038 | $ 1.035 | JPM | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| 02/2016 | € 26.541 | 28.867 | CBK | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| 02/2016 | 870 | 925 | FBF | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| 02/2016 | £ 12.765 | 18.889 | UAG | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| | | | | $ 579 | $ (709) | $ (130) | (0,01) |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$** | **(130)** | **(0,01)** |
| **Summe Anlagen** | **$** | **1.948.240** | **98,20** |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | | |
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 343 | $ 506 | 0,02 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 40 | 40 | 0,00 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 1.107 | 1.107 | 0,06 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 2 | 3 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 12 | 12 | 0,00 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 345 | 345 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 332 | 332 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 168 | 182 | 0,01 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 108 | 160 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 2.695** | **0,14** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ 32.940** | **1,66** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 1.983.875** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Anleihepapier mit Sachwertausschüttung.**

(b) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(c) **Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(d) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 7.090 als Sicherheit für OTC Swap-, Swaption- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(e) **Barmittel in Höhe von USD 3.516 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(f) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 149.434 | $ 1.799.444 | $ 0 | $ 1.948.878 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (638) | 0 | (638) |
| **Summen** | **$ 149.434** | **$ 1.798.806** | **$ 0** | **$ 1.948.240** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 122.289 | $ 1.619.989 | $ 1.902 | $ 1.744.180 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 1.278 | 0 | 1.278 |
| **Summen** | **$ 122.289** | **$ 1.621.267** | **$ 1.902** | **$ 1.745.458** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(g) Abgesicherte Devisenterminkontrakte**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional CAD (Hedged) Class die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CAD | 415 | $ | 300 | BOA | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| 01/2016 | | 25 | | 18 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 291 | CAD | 388 | HUS | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 348 | $ | 251 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 291 | CAD | 388 | JPM | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 382 | $ | 274 | MSB | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 291 | CAD | 388 | MSB | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| 01/2016 | | 271 | | 362 | SCX | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | CAD | 381 | $ | 275 | SOG | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 274 | CAD | 381 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 251 | | 348 | HUS | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | | 274 | | 382 | MSB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 275 | | 381 | SOG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 3 | $ (47) | $ (44) | 0,00 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | € | 115.703 | $ | 127.128 | BOA | $ 1.444 | $ (4) | $ 1.440 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 122.039 | € | 114.463 | BOA | 2.302 | 0 | 2.302 | 0,12 |
| 01/2016 | | 1.497 | | 1.369 | BPS | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | € | 3.016 | $ | 3.306 | BPS | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | | 8.708 | | 9.459 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 15.182 | € | 13.864 | CBK | 0 | (121) | (121) | (0,01) |
| 01/2016 | € | 13.065 | $ | 13.976 | CBK | 14 | (230) | (216) | (0,01) |
| 01/2016 | $ | 1.879 | € | 1.757 | DUB | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| 01/2016 | | 94.088 | | 88.798 | GLM | 2.373 | 0 | 2.373 | 0,12 |
| 01/2016 | € | 115.527 | $ | 126.958 | HUS | 1.461 | 0 | 1.461 | 0,07 |
| 01/2016 | $ | 121.011 | € | 113.553 | HUS | 2.342 | 0 | 2.342 | 0,12 |
| 01/2016 | € | 97.214 | $ | 106.232 | JPM | 629 | 0 | 629 | 0,03 |
| 01/2016 | | 441 | | 469 | NAB | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| 01/2016 | | 96 | | 105 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 147 | | 161 | SCX | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3 | € | 2 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | € | 112.034 | $ | 122.376 | UAG | 672 | 0 | 672 | 0,03 |
| 01/2016 | $ | 129.663 | € | 121.973 | UAG | 2.836 | 0 | 2.836 | 0,14 |
| 02/2016 | | 127.031 | | 115.527 | BOA | 0 | (1.445) | (1.445) | (0,07) |
| 02/2016 | € | 1.174 | $ | 1.290 | BOA | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 127.048 | € | 115.527 | HUS | 0 | (1.462) | (1.462) | (0,07) |
| 02/2016 | | 106.305 | | 97.214 | JPM | 0 | (626) | (626) | (0,03) |
| 02/2016 | € | 2 | $ | 3 | SCX | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | $ | 122.263 | € | 111.853 | UAG | 0 | (671) | (671) | (0,03) |
| | | | | | | $ 14.148 | $ (4.579) | $ 9.569 | 0,48 |

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional GBP (Hedged) Class und Class R GBP (Hedged) die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | $ | 522 | £ | 348 | AZD | $ 0 | $ (10) | $ (10) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 10 | $ | 15 | AZD | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 4.306 | £ | 2.859 | BOA | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 8 | $ | 12 | BOA | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 93.988 | £ | 62.454 | BPS | 0 | (1.937) | (1.937) | (0,10) |
| 01/2016 | £ | 4.539 | $ | 6.690 | BRC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | | 74.597 | | 110.859 | CBK | 911 | 0 | 911 | 0,04 |
| 01/2016 | $ | 105.587 | £ | 69.888 | CBK | 0 | (2.579) | (2.579) | (0,13) |
| 01/2016 | | 105.169 | | 69.764 | DUB | 0 | (2.344) | (2.344) | (0,12) |
| 01/2016 | £ | 69.001 | $ | 102.396 | JPM | 695 | 0 | 695 | 0,03 |
| 01/2016 | | 69.001 | | 102.155 | MSB | 454 | 0 | 454 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 105.348 | £ | 69.876 | MSB | 0 | (2.358) | (2.358) | (0,12) |
| 01/2016 | | 43 | | 29 | RBC | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 01/2016 | £ | 63.797 | $ | 94.418 | SCX | 388 | 0 | 388 | 0,02 |
| 01/2016 | $ | 1.837 | £ | 1.205 | UAG | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| 02/2016 | | 101.567 | | 68.437 | CBK | 0 | (690) | (690) | (0,03) |
| 02/2016 | | 102.400 | | 69.001 | JPM | 0 | (691) | (691) | (0,03) |
| 02/2016 | | 102.162 | | 69.001 | MSB | 0 | (453) | (453) | (0,02) |
| 02/2016 | | 94.426 | | 63.797 | SCX | 0 | (387) | (387) | (0,02) |
| 02/2016 | | 1 | | 0 | UAG | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.448 | $ (11.602) | $ (9.154) | (0,46) |

**(h) Abgesicherte Cross-Currency Swaps**

Zum 31. Dezember 2015 standen für die Institutional EUR (Hedged) Class, Investor EUR (Hedged) Class, Class E EUR (Hedged) und Class R EUR (Hedged) die folgenden Swapkontrakte aus:

**CROSS-CURRENCY SWAPS**

| Erhalt | Zahlung | Fälligkeitsdatum[1] | Kontrahent | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Variabler Zinssatz entspricht 1-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | Variabler Zinssatz entspricht 1-Month EURIBOR abzgl. 0,035 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | 02.07.2016 | GLM | € 13.039 | $ 14.230 | $ (54) | $ 0 | $ (54) | 0,00 |

[1] Am Fälligkeitsdatum wird der Nennbetrag der erhaltenen Währung gegen den Nennbetrag der gelieferten Währung zurückgetauscht.

**(i) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ (10) | $ 0 | $ (10) |
| BOA | 2.220 | (2.910) | (690) |
| BPS | (1.917) | 1.530 | (387) |
| CBK | (2.697) | 2.330 | (367) |
| DUB | (2.314) | 1.650 | (664) |
| FBF | (21) | 0 | (21) |
| GLM | 2.319 | (3.400) | (1.081) |
| HUS | 1.729 | (2.240) | (511) |
| JPM | 59 | 0 | 59 |
| MSB | (1.938) | 1.580 | (358) |
| NAB | (10) | 0 | (10) |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (8) | 0 | (8) |
| UAG | 2.776 | (3.730) | (954) |

[1] Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(j) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 98,24 | 97,84 |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,03) | 0,01 |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | (0,01) | 0,06 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## US High Yield Bond Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 133.137.646 | $ | 1.332.217 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| CPG Merger Sub LLC 8,000 % fällig am 01.10.2021 | $ | 12.500 | | 12.711 |
| DJO Finco, Inc. 8,125 % fällig am 15.06.2021 | | 10.000 | | 10.049 |
| Sun Products Corp. 7,750 % fällig am 15.03.2021 | | 11.000 | | 9.936 |
| Univision Communications, Inc. 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 9.000 | | 8.986 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.03.2015 | | 8.700 | | 8.700 |
| Altice Financing S.A. 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 8.000 | | 8.144 |
| First Data Corp. 7,000 % fällig am 01.12.2023 | | 8.000 | | 7.990 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 7.500 | | 7.598 |
| Valeant Pharmaceuticals International, Inc. 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 7.500 | | 7.361 |
| Ply Gem Industries, Inc. 6,500 % fällig am 01.02.2022 | | 7.500 | | 7.286 |
| Argos Merger Sub, Inc. 7,125 % fällig am 15.03.2023 | | 7.125 | | 7.273 |
| Air Medical Merger Sub Corp. 6,375 % fällig am 15.05.2023 | | 7.250 | | 7.138 |
| PSPC Escrow Corp. 6,500 % fällig am 01.02.2022 | | 7.000 | | 7.108 |
| Alere, Inc. 6,375 % fällig am 01.07.2023 | | 7.000 | | 7.063 |
| Endo Ltd. 6,000 % fällig am 01.02.2025 | | 7.000 | | 6.993 |
| Informatica LLC 7,125 % fällig am 15.07.2023 | | 7.000 | | 6.973 |
| SIG Combibloc Holdings SCA 7,750 % fällig am 15.02.2023 | € | 6.000 | | 6.939 |
| New Red Finance, Inc. 6,000 % fällig am 01.04.2022 | $ | 6.500 | | 6.724 |
| Blue Coat Holdings, Inc. 8,375 % fällig am 01.06.2023 | | 6.500 | | 6.559 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 130.418.811 | $ | 1.305.000 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 13.03.2015 | $ | 8.700 | | 8.700 |
| Griffon Corp. 5,250 % fällig am 01.03.2022 | | 6.000 | | 5.970 |
| CIT Group, Inc. 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 5.500 | | 5.656 |
| Univision Communications, Inc. 8,500 % fällig am 15.05.2021 | | 5.250 | | 5.587 |
| General Motors Financial Co., Inc. 4,250 % fällig am 15.05.2023 | | 5.500 | | 5.585 |
| H.J. Heinz Co. 4,250 % fällig am 15.10.2020 | | 5.000 | | 5.104 |
| Masonite International Corp. 8,250 % fällig am 15.04.2021 | | 4.750 | | 5.070 |
| Federal Home Loan Bank 0,000 % fällig am 24.04.2015 | | 4.700 | | 4.699 |
| Crown Castle International Corp. 5,250 % fällig am 15.01.2023 | | 4.500 | | 4.698 |
| Barclays PLC 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 4.000 | | 4.452 |
| H.J. Heinz Finance Co. 7,125 % fällig am 01.08.2039 | $ | 3.500 | | 4.330 |
| Biomet, Inc. 6,500 % fällig am 01.08.2020 | | 4.000 | | 4.240 |
| CBRE Services, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 4.000 | | 4.161 |
| Lloyds Banking Group PLC 6,375 % fällig am 27.06.2049 | € | 3.396 | | 3.949 |
| Springleaf Finance Corp. 6,900 % fällig am 15.12.2017 | $ | 3.500 | | 3.745 |
| CSC Holdings LLC 8,625 % fällig am 15.02.2019 | | 3.000 | | 3.473 |
| Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 29.12.2049 | | 3.250 | | 3.330 |
| Sealed Air Corp. 6,500 % fällig am 01.12.2020 | | 3.000 | | 3.325 |
| General Motors Financial Co., Inc. 3,250 % fällig am 15.05.2018 | | 3.250 | | 3.299 |

(a) Der US High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US Short-Term Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 1,444 % fällig am 29.07.2020 | $ | 800 | $ 802 | 0,13 |
| **Macquarie Group Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 03.12.2018 | | 2.000 | 2.020 | 0,32 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2020 | | 900 | 994 | 0,16 |
| 7,625 % fällig am 13.08.2019 | | 1.000 | 1.146 | 0,18 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 400 | 406 | 0,06 |
| | | | 5.368 | 0,85 |
| **BERMUDAS** | | | | |
| **Weatherford International Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2016 | | 3.500 | 3.487 | 0,55 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Banco Nacional de Desenvolvimento Economico e Social** | | | | |
| 3,375 % fällig am 26.09.2016 | | 2.000 | 1.985 | 0,31 |
| **Banco Santander Brasil S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.01.2016 | | 400 | 399 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 13.02.2017 | | 1.900 | 1.926 | 0,31 |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.07.2016 | BRL | 23.000 | 5.423 | 0,86 |
| **Embraer Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.01.2017 | $ | 1.000 | 1.035 | 0,16 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,886 % fällig am 17.03.2017 | | 4.100 | 3.767 | 0,60 |
| | | | 14.535 | 2,30 |
| **BRITISCHE JUNGFERNINSELN** | | | | |
| **Cheung Kong Infrastructure Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 1,270 % fällig am 20.06.2017 | | 3.000 | 2.987 | 0,47 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Banco Continental S.A. via Continental Senior Trustees II Cayman Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.01.2017 | | 2.500 | 2.575 | 0,41 |
| **Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.** | | | | |
| 1,547 % fällig am 20.04.2022 | | 1.750 | 1.742 | 0,28 |
| **COA Summit CLO Ltd.** | | | | |
| 1,667 % fällig am 20.04.2023 | | 2.325 | 2.322 | 0,37 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | | |
| 0,674 % fällig am 01.03.2021 | | 80 | 79 | 0,01 |
| 1,615 % fällig am 19.01.2023 | | 588 | 588 | 0,09 |
| **Cornerstone CLO Ltd.** | | | | |
| 0,541 % fällig am 15.07.2021 | | 711 | 706 | 0,11 |
| **Dryden XXII Senior Loan Fund** | | | | |
| 1,491 % fällig am 15.01.2022 | | 1.905 | 1.902 | 0,30 |
| **Fortress Credit Investments IV Ltd.** | | | | |
| 1,565 % fällig am 17.07.2023 | | 1.216 | 1.215 | 0,19 |
| **Fraser Sullivan CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,362 % fällig am 20.04.2023 | | 1.188 | 1.187 | 0,19 |
| **Gallatin CLO VII Ltd.** | | | | |
| 1,591 % fällig am 15.07.2023 | | 2.936 | 2.918 | 0,46 |
| **Goldentree Loan Opportunities VI Ltd.** | | | | |
| 1,615 % fällig am 17.04.2022 | | 3.333 | 3.333 | 0,53 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | |
| 1,691 % fällig am 15.07.2023 | | 2.647 | 2.638 | 0,42 |
| **LCM IX LP** | | | | |
| 1,521 % fällig am 14.07.2022 | | 1.462 | 1.461 | 0,23 |
| **Limerock CLO I** | | | | |
| 0,530 % fällig am 24.04.2023 | | 635 | 628 | 0,10 |
| **Lockwood Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 1,690 % fällig am 25.01.2024 | | 3.800 | 3.787 | 0,60 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | |
| 1,652 % fällig am 15.08.2022 | | 1.200 | 1.197 | 0,19 |
| **Noble Holding International Ltd.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 01.03.2016 | | 1.800 | 1.800 | 0,28 |
| **Ocean Trails CLO I** | | | | |
| 0,571 % fällig am 12.10.2020 | | 1.582 | 1.565 | 0,25 |
| **Selkirk No 3 Ltd.** | | | | |
| 1,860 % fällig am 20.12.2041 | $ | 1.501 | $ 1.497 | 0,24 |
| **Symphony CLO VIII LP** | | | | |
| 1,419 % fällig am 09.01.2023 | | 3.424 | 3.408 | 0,54 |
| **Venture XI CLO Ltd.** | | | | |
| 1,662 % fällig am 14.11.2022 | | 3.000 | 2.982 | 0,47 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 1,655 % fällig am 17.07.2024 | | 2.000 | 1.989 | 0,31 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 1,621 % fällig am 15.10.2022 | | 900 | 893 | 0,14 |
| **Westwood CDO II Ltd.** | | | | |
| 0,540 % fällig am 25.04.2022 | | 1.672 | 1.639 | 0,26 |
| | | | 44.051 | 6,97 |
| **CHILE** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 1,221 % fällig am 11.04.2017 | | 1.000 | 989 | 0,16 |
| 1,915 % fällig am 19.01.2016 | | 1.300 | 1.299 | 0,20 |
| | | | 2.288 | 0,36 |
| **CHINA** | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | | 2.700 | 2.697 | 0,43 |
| 1,241 % fällig am 10.04.2019 | | 1.000 | 995 | 0,16 |
| 1,750 % fällig am 10.04.2017 | | 900 | 897 | 0,14 |
| | | | 4.589 | 0,73 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,490 %) fällig am 12.02.2016 | CZK | 8.000 | 322 | 0,05 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **Realkredit Danmark** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.01.2016 | DKK | 25.000 | 3.639 | 0,58 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 1,203 % fällig am 23.06.2017 | $ | 3.200 | 3.194 | 0,50 |
| 1,375 % fällig am 06.03.2017 | £ | 1.000 | 1.478 | 0,23 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 1,047 % fällig am 12.06.2017 | $ | 1.500 | 1.496 | 0,24 |
| 1,121 % fällig am 15.04.2019 | | 4.500 | 4.478 | 0,71 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 0,777 % fällig am 20.01.2017 | | 3.200 | 3.198 | 0,50 |
| **Orange S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 14.09.2016 | | 1.800 | 1.821 | 0,29 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 12.04.2016 (a) | | 9.943 | 10.028 | 1,59 |
| | | | 25.693 | 4,06 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **Hypothekenbank Frankfurt AG** | | | | |
| 0,347 % fällig am 20.09.2017 | | 1.500 | 1.482 | 0,23 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 1.000 | 995 | 0,16 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 14.05.2017 | | 1.100 | 1.098 | 0,17 |
| 2,750 % fällig am 19.04.2017 | | 1.500 | 1.517 | 0,24 |
| | | | 3.610 | 0,57 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 13.01.2017 | | 1.300 | 1.305 | 0,21 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | | 3.045 | 3.046 | 0,48 |
| | | | 4.351 | 0,69 |
| **JAPAN** | | | | |
| **Japan Bank for International Cooperation** | | | | |
| 0,719 % fällig am 13.11.2018 | | 7.000 | 7.036 | 1,11 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 1,500 % fällig am 12.09.2017 | | 5.000 | 4.989 | 0,79 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 1,091 % fällig am 23.07.2019 | $ | 1.500 | $ 1.488 | 0,24 |
| 1,875 % fällig am 17.10.2016 | | 2.000 | 2.003 | 0,32 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.10.2020 | | 2.800 | 2.800 | 0,44 |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 0,747 % fällig am 16.04.2017 | | 2.000 | 1.994 | 0,32 |
| 1,243 % fällig am 26.03.2018 | | 4.600 | 4.583 | 0,72 |
| **Nomura Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.09.2016 | | 5.500 | 5.523 | 0,87 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 1,056 % fällig am 23.07.2018 | | 3.400 | 3.394 | 0,54 |
| 1,800 % fällig am 18.07.2017 | | 1.000 | 1.000 | 0,16 |
| 2,900 % fällig am 22.07.2016 | | 1.500 | 1.514 | 0,24 |
| | | | 36.324 | 5,75 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **Highlander Euro CDO BV** | | | | |
| 0,488 % fällig am 06.09.2022 | € | 1.156 | 1.252 | 0,20 |
| **UBS Group Funding Jersey Ltd.** | | | | |
| 2,034 % fällig am 24.09.2020 | $ | 2.000 | 2.009 | 0,32 |
| | | | 3.261 | 0,52 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,582 % fällig am 12.03.2018 | | 2.800 | 2.811 | 0,44 |
| 1,757 % fällig am 12.03.2020 (a) | | 6.200 | 6.228 | 0,99 |
| 1,850 % fällig am 01.03.2017 | | 2.000 | 2.004 | 0,32 |
| | | | 11.043 | 1,75 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **Penerbangan Malaysia Bhd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2016 | | 2.900 | 2.923 | 0,46 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **America Movil SAB de C.V.** | | | | |
| 1,502 % fällig am 12.09.2016 | | 900 | 900 | 0,14 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.03.2016 | | 700 | 704 | 0,11 |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 8,500 % fällig am 13.12.2018 | MXN | 4.000 | 255 | 0,04 |
| **Mexico Treasury Bills** | | | | |
| 3,290 % fällig am 03.03.2016 | | 80.000 | 461 | 0,08 |
| | | | 2.320 | 0,37 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 30.04.2018 | $ | 400 | 431 | 0,07 |
| **Harbourmaster CLO 9 BV** | | | | |
| 0,872 % fällig am 08.05.2023 | £ | 3.865 | 5.605 | 0,89 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 22.01.2019 | $ | 1.600 | 1.581 | 0,25 |
| 3,000 % fällig am 23.10.2017 | | 4.150 | 4.164 | 0,66 |
| **Malin CLO BV** | | | | |
| 0,124 % fällig am 07.05.2023 | € | 849 | 916 | 0,14 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 0,804 % fällig am 18.11.2016 | $ | 3.000 | 2.956 | 0,47 |
| | | | 15.653 | 2,48 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.05.2016 | | 1.200 | 1.202 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 26.06.2017 | | 1.000 | 1.042 | 0,16 |
| **Statoil ASA** | | | | |
| 0,804 % fällig am 08.11.2018 | | 750 | 745 | 0,12 |
| | | | 2.989 | 0,47 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **BOC Aviation Pte Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.10.2017 | | 500 | 502 | 0,08 |
| **DBS Bank Ltd.** | | | | |
| 0,931 % fällig am 15.07.2021 | | 2.200 | 2.202 | 0,35 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.10.2022 | $ | 800 | $ 803 | 0,12 |
| | | | 3.507 | 0,55 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,071 % fällig am 14.01.2017 | | 4.000 | 4.007 | 0,64 |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 1,333 % fällig am 18.03.2017 | | 4.800 | 4.788 | 0,76 |
| **Industrial Bank of Korea** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.07.2017 | | 3.600 | 3.625 | 0,57 |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 1,375 % fällig am 05.02.2016 | | 2.300 | 2.300 | 0,36 |
| **Kia Motors Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.06.2016 | | 1.130 | 1.139 | 0,18 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 0,945 % fällig am 22.01.2017 | | 4.753 | 4.756 | 0,75 |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 1,158 % fällig am 22.05.2017 | | 1.000 | 1.000 | 0,16 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 03.04.2017 | | 500 | 508 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 27.10.2016 | | 5.300 | 5.409 | 0,86 |
| **KT Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 03.05.2016 | | 1.000 | 1.013 | 0,16 |
| | | | 28.545 | 4,52 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 1,243 % fällig am 23.06.2017 | | 1.600 | 1.591 | 0,25 |
| 3,992 % fällig am 16.02.2016 | | 3.425 | 3.435 | 0,54 |
| 6,221 % fällig am 03.07.2017 | | 1.000 | 1.063 | 0,17 |
| 6,421 % fällig am 20.06.2016 | | 1.800 | 1.842 | 0,29 |
| | | | 7.931 | 1,25 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| **Corporation Andina de Fomento** | | | | |
| 0,874 % fällig am 29.01.2018 | | 2.000 | 1.984 | 0,31 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 1,002 % fällig am 14.08.2019 | | 1.100 | 1.092 | 0,17 |
| 1,264 % fällig am 01.06.2020 | | 2.400 | 2.393 | 0,38 |
| 1,303 % fällig am 26.03.2018 | | 2.500 | 2.497 | 0,40 |
| | | | 5.982 | 0,95 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Abbey National Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,013 % fällig am 29.09.2017 | | 1.560 | 1.548 | 0,24 |
| 1,232 % fällig am 24.08.2018 | | 3.000 | 3.001 | 0,47 |
| **Anglo American Capital PLC** | | | | |
| 1,271 % fällig am 15.04.2016 | | 250 | 248 | 0,04 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,022 % fällig am 15.06.2018 | | 3.300 | 3.297 | 0,52 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | £ | 700 | 1.092 | 0,17 |
| 6,500 % fällig am 30.11.2072 | $ | 750 | 793 | 0,13 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 0,764 % fällig am 07.11.2016 (a) | | 6.930 | 6.922 | 1,10 |
| 0,851 % fällig am 10.05.2018 | | 170 | 169 | 0,03 |
| 1,233 % fällig am 26.09.2018 | | 2.000 | 1.980 | 0,31 |
| **Eurosail-UK PLC** | | | | |
| 0,885 % fällig am 13.06.2045 | £ | 436 | 636 | 0,10 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 1,152 % fällig am 06.09.2017 | $ | 2.100 | 2.090 | 0,33 |
| 1,303 % fällig am 30.09.2016 | | 1.700 | 1.696 | 0,27 |
| **Imperial Tobacco Finance PLC** | | | | |
| 2,050 % fällig am 20.07.2018 | | 2.000 | 1.990 | 0,32 |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 1.000 | 1.003 | 0,16 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | | 500 | 542 | 0,09 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 12.05.2016 | | 2.900 | 2.921 | 0,46 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 0,752 % fällig am 19.02.2016 | | 2.530 | 2.529 | 0,40 |
| | | | 32.457 | 5,14 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **USA** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **ACS Pass-Through Trust** | | | |
| 0,586 % fällig am 14.06.2037 $ | 536 | $ 518 | 0,08 |
| **AmeriCredit Automobile Receivables Trust** | | | |
| 0,596 % fällig am 09.04.2018 | 1.027 | 1.027 | 0,16 |
| **California Republic Auto Receivables Trust** | | | |
| 0,630 % fällig am 15.06.2017 | 432 | 431 | 0,07 |
| **Citibank Credit Card Issuance Trust** | | | |
| 0,361 % fällig am 17.12.2018 | 1.000 | 998 | 0,16 |
| **Ford Credit Auto Lease Trust** | | | |
| 1,040 % fällig am 15.05.2018 | 3.000 | 2.992 | 0,47 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | |
| 0,831 % fällig am 15.12.2021 | 434 | 432 | 0,07 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | |
| 0,820 % fällig am 25.10.2017 | 30 | 30 | 0,01 |
| 0,870 % fällig am 25.10.2017 | 169 | 169 | 0,03 |
| 0,872 % fällig am 25.09.2026 | 3.527 | 3.431 | 0,54 |
| | | 10.028 | 1,59 |
| **VERPFLICHTUNGEN AUS BANKDARLEHEN** | | | |
| **Avago Technologies Cayman Ltd.** | | | |
| 4,250 % fällig am 06.11.2022 | 900 | 890 | 0,14 |
| **Chrysler Group LLC** | | | |
| 3,500 % fällig am 24.05.2017 | 1.880 | 1.877 | 0,30 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | |
| 3,657 % fällig am 31.12.2018 | 2.185 | 2.157 | 0,34 |
| **CSC Holdings LLC** | | | |
| 2,924 % fällig am 17.04.2020 | 1.397 | 1.394 | 0,22 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | 2.200 | 2.190 | 0,35 |
| **Energy Future Intermediate Holding Co. LLC** | | | |
| 4,250 % fällig am 19.06.2016 | 1.000 | 998 | 0,16 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 09.11.2022 | 400 | 401 | 0,06 |
| | | 9.907 | 1,57 |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Electricite de France S.A.** | | | |
| 1,535 % fällig am 09.01.2017 | 1.000 | 984 | 0,15 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **AES Corp.** | | | |
| 3,414 % fällig am 01.06.2019 | 1.900 | 1.748 | 0,28 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2016 | 625 | 625 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 13.02.2018 | 900 | 898 | 0,14 |
| 3,500 % fällig am 18.07.2016 | 100 | 100 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2017 | 5.300 | 5.472 | 0,87 |
| **American Express Credit Corp.** | | | |
| 0,852 % fällig am 15.08.2019 | 3.200 | 3.133 | 0,50 |
| 1,114 % fällig am 05.11.2018 | 3.000 | 3.002 | 0,47 |
| **Amgen, Inc.** | | | |
| 0,758 % fällig am 22.05.2017 (a) | 5.200 | 5.189 | 0,82 |
| **Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.** | | | |
| 0,729 % fällig am 01.02.2019 | 3.640 | 3.577 | 0,57 |
| **Anthem, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 15.07.2018 | 1.000 | 999 | 0,16 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | 2.200 | 2.187 | 0,35 |
| **Aviation Capital Group Corp.** | | | |
| 2,875 % fällig am 17.09.2018 | 2.300 | 2.290 | 0,36 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 5,650 % fällig am 01.05.2018 | 700 | 753 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 25.04.2018 | 4.336 | 4.786 | 0,76 |
| **Baxalta, Inc.** | | | |
| 1,366 % fällig am 22.06.2018 | 5.665 | 5.651 | 0,89 |
| **BB&T Corp.** | | | |
| 0,989 % fällig am 01.02.2019 | 1.600 | 1.587 | 0,25 |
| **BellSouth LLC** | | | |
| 4,821 % fällig am 26.04.2016 | 4.000 | 4.048 | 0,64 |
| **BMW US Capital LLC** | | | |
| 0,756 % fällig am 02.06.2017 | 6.200 | 6.163 | 0,97 |
| **BOKF N.A.** | | | |
| 1,052 % fällig am 15.05.2017 | 500 | 499 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.08.2017 | $ | 3.500 | $ 3.587 | 0,57 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2018 | | 500 | 517 | 0,08 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,202 % fällig am 30.07.2018 | | 3.000 | 3.000 | 0,47 |
| 1,630 % fällig am 26.10.2020 | | 1.200 | 1.212 | 0,19 |
| **ConAgra Foods, Inc.** | | | | |
| 0,687 % fällig am 21.07.2016 | | 30 | 30 | 0,00 |
| **ConocoPhillips Co.** | | | | |
| 1,262 % fällig am 15.05.2022 | | 2.200 | 2.171 | 0,34 |
| **Daimler Finance N.A. LLC** | | | | |
| 1,044 % fällig am 03.08.2017 (a) | | 3.200 | 3.198 | 0,51 |
| 1,189 % fällig am 01.08.2018 | | 4.300 | 4.283 | 0,68 |
| 1,650 % fällig am 02.03.2018 | | 500 | 494 | 0,08 |
| 1,875 % fällig am 11.01.2018 | | 2.000 | 1.993 | 0,31 |
| 2,400 % fällig am 10.04.2017 | | 3.000 | 3.016 | 0,48 |
| **Dayton Power & Light Co.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2016 | | 4.700 | 4.705 | 0,74 |
| **Denali Borrower LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2020 | | 1.400 | 1.470 | 0,23 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 01.02.2016 | | 2.700 | 2.710 | 0,43 |
| **DR Horton, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.03.2019 | | 1.300 | 1.303 | 0,21 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 0,523 % fällig am 28.07.2017 | | 1.300 | 1.285 | 0,20 |
| 0,809 % fällig am 01.08.2019 | | 3.775 | 3.648 | 0,58 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.06.2018 | | 500 | 479 | 0,08 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.02.2016 | | 900 | 900 | 0,14 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 1,400 % fällig am 15.04.2016 | | 1.000 | 1.000 | 0,16 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.08.2016 | | 2.200 | 2.251 | 0,36 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,982 % fällig am 08.09.2017 | | 3.600 | 3.551 | 0,56 |
| 1,095 % fällig am 17.01.2017 | | 3.000 | 2.978 | 0,47 |
| 1,332 % fällig am 12.03.2019 | | 500 | 490 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 17.01.2017 | | 1.500 | 1.490 | 0,24 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2016 | | 3.000 | 3.001 | 0,47 |
| **Freeport-McMoran Oil & Gas LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.05.2021 | | 800 | 490 | 0,08 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 01.03.2017 | | 1.600 | 1.472 | 0,23 |
| 2,300 % fällig am 14.11.2017 | | 500 | 428 | 0,07 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.10.2018 | | 1.400 | 1.418 | 0,22 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 1,681 % fällig am 10.04.2018 | | 3.600 | 3.575 | 0,56 |
| 1,881 % fällig am 15.01.2020 | | 1.000 | 985 | 0,16 |
| 2,625 % fällig am 10.07.2017 | | 195 | 196 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 15.05.2018 | | 800 | 804 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 15.08.2017 | | 5.600 | 5.806 | 0,92 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 2,539 % fällig am 15.11.2019 | | 1.000 | 995 | 0,16 |
| 5,400 % fällig am 01.11.2020 | | 1.200 | 1.325 | 0,21 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | |
| 1,567 % fällig am 27.05.2016 | | 500 | 492 | 0,08 |
| 1,700 % fällig am 27.05.2016 | | 3.645 | 3.627 | 0,57 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,476 % fällig am 23.04.2020 (a) | | 4.600 | 4.612 | 0,73 |
| 1,712 % fällig am 15.09.2020 | | 500 | 502 | 0,08 |
| 2,012 % fällig am 29.11.2023 (a) | | 7.750 | 7.833 | 1,24 |
| 5,375 % fällig am 15.03.2020 | | 500 | 550 | 0,09 |
| 7,750 % fällig am 23.11.2016 | AUD | 2.500 | 1.888 | 0,30 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2019 | $ | 1.200 | 1.212 | 0,19 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 2,353 % fällig am 05.10.2017 | | 1.000 | 1.002 | 0,16 |
| 2,543 % fällig am 05.10.2018 | | 1.000 | 1.003 | 0,16 |
| **HSBC Finance Corp.** | | | | |
| 0,844 % fällig am 01.06.2016 | | 4.043 | 4.036 | 0,64 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.04.2016 | | 490 | 493 | 0,08 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2016 | | 4.500 | 4.567 | 0,72 |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| 7,125 % fällig am 01.09.2018 | $ 200 | $ 220 | 0,03 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2017 | 500 | 534 | 0,08 |
| **Jersey Central Power & Light Co.** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2016 | 4.000 | 4.051 | 0,64 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 0,870 % fällig am 25.04.2018 | 4.400 | 4.372 | 0,69 |
| 1,271 % fällig am 23.01.2020 | 2.000 | 2.004 | 0,32 |
| **Kansas City Southern** | | | |
| 1,023 % fällig am 28.10.2016 | 1.200 | 1.186 | 0,19 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2016 | 2.835 | 2.844 | 0,45 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2017 | 1.000 | 1.012 | 0,16 |
| **Kinder Morgan Finance Co. LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2018 | 3.800 | 3.833 | 0,61 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | |
| 7,250 % fällig am 01.06.2018 | 1.957 | 2.033 | 0,32 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 1,600 % fällig am 30.06.2017 | 900 | 898 | 0,14 |
| **Laclede Group, Inc.** | | | |
| 1,112 % fällig am 15.08.2017 | 1.000 | 996 | 0,16 |
| **Lowe's Cos., Inc.** | | | |
| 0,907 % fällig am 10.09.2019 | 3.000 | 2.984 | 0,47 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2017 | 2.043 | 2.083 | 0,33 |
| **McGraw Hill Financial, Inc.** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.08.2018 | 1.000 | 1.007 | 0,16 |
| **Medtronic, Inc.** | | | |
| 1,312 % fällig am 15.03.2020 | 2.500 | 2.495 | 0,39 |
| **MGM Resorts International** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2016 | 30 | 30 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.06.2016 | 1.900 | 1.940 | 0,31 |
| 7,625 % fällig am 15.01.2017 | 900 | 940 | 0,15 |
| **MUFG Union Bank N.A.** | | | |
| 0,734 % fällig am 05.05.2017 | 500 | 498 | 0,08 |
| **Mylan, Inc.** | | | |
| 1,800 % fällig am 24.06.2016 (a) | 6.500 | 6.497 | 1,03 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 6,250 % fällig am 25.01.2016 | 2.357 | 2.363 | 0,37 |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | 500 | 527 | 0,08 |
| **NBCUniversal Enterprise, Inc.** | | | |
| 1,006 % fällig am 15.04.2018 (a) | 2.640 | 2.637 | 0,42 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 1,303 % fällig am 26.09.2016 | 3.200 | 3.200 | 0,51 |
| **Oracle Corp.** | | | |
| 0,828 % fällig am 08.10.2019 | 1.000 | 998 | 0,16 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.03.2016 | 6.000 | 6.011 | 0,95 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2016 | 3.100 | 3.149 | 0,50 |
| 6,650 % fällig am 15.03.2017 | 555 | 573 | 0,09 |
| **Piper Jaffray Cos** | | | |
| 5,060 % fällig am 09.10.2018 | 1.800 | 1.797 | 0,28 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | |
| 0,920 % fällig am 20.05.2020 | 500 | 490 | 0,08 |
| **Reliance Standard Life Global Funding II** | | | |
| 2,150 % fällig am 15.10.2018 | 1.500 | 1.492 | 0,24 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 12.06.2018 | 1.300 | 1.309 | 0,21 |
| 3,500 % fällig am 04.08.2016 | 2.204 | 2.228 | 0,35 |
| 7,750 % fällig am 01.06.2018 | 30 | 34 | 0,00 |
| **Roche Holdings, Inc.** | | | |
| 0,943 % fällig am 30.09.2019 | 3.200 | 3.169 | 0,50 |
| **Sabine Pass LNG LP** | | | |
| 7,500 % fällig am 30.11.2016 | 300 | 300 | 0,05 |
| **SBA Tower Trust** | | | |
| 2,898 % fällig am 15.10.2019 | 500 | 490 | 0,08 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2018 | 900 | 739 | 0,12 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 6,900 % fällig am 15.12.2017 | 2.700 | 2.801 | 0,44 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.12.2016 | 6.700 | 6.700 | 1,06 |
| 8,375 % fällig am 15.08.2017 | 500 | 493 | 0,08 |
| **Synchrony Financial** | | | |
| 1,564 % fällig am 03.02.2020 | 2.250 | 2.217 | 0,35 |
| 1,875 % fällig am 15.08.2017 | 300 | 299 | 0,05 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2017 | $ 300 | $ 308 | 0,05 |
| **Toll Brothers Finance Corp.** | | | |
| 8,910 % fällig am 15.10.2017 | 250 | 280 | 0,04 |
| **UAL 2009-1 Pass-Through Trust** | | | |
| 10,400 % fällig am 01.11.2016 | 211 | 224 | 0,03 |
| **UAL 2009-2A Pass-Through Trust** | | | |
| 9,750 % fällig am 15.01.2017 | 1.972 | 2.083 | 0,33 |
| **US Bank N.A.** | | | |
| 0,803 % fällig am 28.10.2019 | 2.000 | 1.987 | 0,31 |
| **USG Corp.** | | | |
| 6,300 % fällig am 15.11.2016 | 2.300 | 2.382 | 0,38 |
| 7,875 % fällig am 30.03.2020 | 1.000 | 1.052 | 0,17 |
| 9,750 % fällig am 15.01.2018 | 1.800 | 2.011 | 0,32 |
| **Vereit Operating Partnership LP** | | | |
| 2,000 % fällig am 06.02.2017 | 2.200 | 2.183 | 0,34 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 1,296 % fällig am 17.06.2019 | 2.619 | 2.603 | 0,41 |
| 2,252 % fällig am 14.09.2018 (a) | 8.560 | 8.771 | 1,39 |
| **Viacom, Inc.** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2016 | 650 | 651 | 0,10 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 1,600 % fällig am 20.11.2017 | 500 | 486 | 0,08 |
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 1,023 % fällig am 26.06.2017 | 4.400 | 4.255 | 0,67 |
| **Wachovia Corp.** | | | |
| 0,691 % fällig am 15.10.2016 | 3.800 | 3.794 | 0,60 |
| **Walgreens Boots Alliance, Inc.** | | | |
| 0,814 % fällig am 18.05.2016 | 1.900 | 1.894 | 0,30 |
| **West Penn Power Co.** | | | |
| 5,950 % fällig am 15.12.2017 | 985 | 1.056 | 0,17 |
| **Williams Partners LP** | | | |
| 7,250 % fällig am 01.02.2017 | 1.000 | 1.020 | 0,16 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 100 | 89 | 0,01 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | 500 | 506 | 0,08 |
| | | 280.888 | 44,44 |

**MORTGAGE-BACKED SECURITIES**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,131 % fällig am 15.06.2028 | 100 | 100 | 0,02 |
| 1,547 % fällig am 15.12.2029 | 250 | 251 | 0,04 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,415 % fällig am 10.09.2047 | 3.734 | 3.809 | 0,60 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | 580 | 585 | 0,09 |
| **Banc of America Re-REMIC Trust** | | | |
| 9,867 % fällig am 24.12.2049 | 169 | 175 | 0,03 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 2,596 % fällig am 26.10.2035 | 35 | 35 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,555 % fällig am 25.02.2036 (b) | 34 | 32 | 0,01 |
| **Bear Stearns Alternative-A Trust** | | | |
| 0,862 % fällig am 25.04.2035 | 762 | 738 | 0,12 |
| 2,726 % fällig am 25.09.2035 | 49 | 42 | 0,01 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2031 | 74 | 74 | 0,01 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 5,533 % fällig am 11.09.2041 | 1.474 | 1.495 | 0,24 |
| **Carefree Portfolio Trust** | | | |
| 1,651 % fällig am 15.11.2019 | 6.100 | 6.137 | 0,97 |
| **CDGJ Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,731 % fällig am 15.12.2027 | 700 | 697 | 0,11 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,611 % fällig am 15.07.2027 | 3.000 | 3.011 | 0,48 |
| 5,811 % fällig am 15.03.2049 | 1.563 | 1.570 | 0,25 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 0,421 % fällig am 25.11.2045 | 1.132 | 1.104 | 0,17 |
| **COBALT CMBS Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,484 % fällig am 15.04.2047 | 2.298 | 2.363 | 0,37 |
| 5,766 % fällig am 15.05.2046 | 1.293 | 1.352 | 0,21 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,796 % fällig am 10.12.2049 | 2.998 | 3.113 | 0,49 |
| **Credit Suisse Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,297 % fällig am 15.12.2039 | $ 1.423 | $ 1.455 | 0,23 |
| 5,311 % fällig am 15.12.2039 | 1.411 | 1.427 | 0,23 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 2,621 % fällig am 25.09.2034 | 983 | 981 | 0,16 |
| **FHLMC Structured Pass-Through Securities** | | | |
| 1,643 % fällig am 25.07.2044 | 15 | 15 | 0,00 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 0,492 % fällig am 25.08.2037 | 387 | 198 | 0,03 |
| **GCAT** | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2020 | 457 | 454 | 0,07 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,144 % fällig am 10.05.2045 | 147 | 147 | 0,02 |
| 5,560 % fällig am 10.11.2039 | 1.846 | 1.844 | 0,29 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,261 % fällig am 25.06.2034 | 203 | 196 | 0,03 |
| 2,824 % fällig am 25.11.2035 (b) | 611 | 556 | 0,09 |
| **Hudsons Bay Simon JV Trust** | | | |
| 1,849 % fällig am 05.08.2034 | 700 | 702 | 0,11 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 5,397 % fällig am 15.05.2045 | 1.870 | 1.890 | 0,30 |
| 5,440 % fällig am 12.06.2047 | 3.606 | 3.695 | 0,58 |
| 5,678 % fällig am 12.02.2049 | 64 | 65 | 0,01 |
| 5,695 % fällig am 12.02.2049 | 2.131 | 2.225 | 0,35 |
| 5,794 % fällig am 12.02.2051 | 1.325 | 1.379 | 0,22 |
| 5,909 % fällig am 15.04.2045 | 806 | 814 | 0,13 |
| **LB Commercial Conduit Mortgage Trust** | | | |
| 6,410 % fällig am 15.06.2031 | 684 | 714 | 0,11 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 5,424 % fällig am 15.02.2040 | 1.327 | 1.358 | 0,22 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors, Inc.** | | | |
| 2,154 % fällig am 25.03.2033 | 1.770 | 1.756 | 0,28 |
| 2,286 % fällig am 25.05.2033 | 833 | 810 | 0,13 |
| **Morgan Stanley Capital I Trust** | | | |
| 0,465 % fällig am 12.07.2044 | 1.292 | 1.290 | 0,20 |
| 1,085 % fällig am 15.03.2045 | 70 | 70 | 0,01 |
| 5,332 % fällig am 15.12.2043 | 1.744 | 1.776 | 0,28 |
| 5,809 % fällig am 12.12.2049 | 3.060 | 3.200 | 0,51 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,692 % fällig am 25.09.2035 | 214 | 213 | 0,03 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 0,762 % fällig am 25.09.2034 | 69 | 60 | 0,01 |
| **Pretium Mortgage Credit Partners I LLC** | | | |
| 4,125 % fällig am 27.10.2030 | 292 | 290 | 0,05 |
| **RBSCF Trust** | | | |
| 5,692 % fällig am 16.04.2049 | 700 | 719 | 0,11 |
| 5,952 % fällig am 16.02.2051 | 459 | 466 | 0,07 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,570 % fällig am 25.03.2034 | 57 | 56 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 1,262 % fällig am 25.08.2034 | 618 | 608 | 0,10 |
| **Structured Asset Mortgage Investments II Trust** | | | |
| 1,062 % fällig am 19.10.2034 | 1.658 | 1.597 | 0,25 |
| **Sunset Mortgage Loan Co. LLC** | | | |
| 4,459 % fällig am 16.09.2045 | 677 | 676 | 0,11 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 0,561 % fällig am 15.04.2047 | 4.600 | 4.454 | 0,71 |
| 5,713 % fällig am 15.06.2049 | 2.000 | 2.051 | 0,32 |
| 5,767 % fällig am 15.05.2043 | 3.000 | 3.016 | 0,48 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,652 % fällig am 25.04.2045 | 7 | 7 | 0,00 |
| 0,692 % fällig am 25.12.2045 | 149 | 144 | 0,02 |
| 2,429 % fällig am 25.10.2035 | 1.473 | 1.420 | 0,22 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,763 % fällig am 25.03.2036 | 182 | 181 | 0,03 |
| 2,823 % fällig am 25.01.2035 | 1.114 | 1.129 | 0,18 |
| | | 72.787 | 11,52 |

**KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Hughes, South Dakota, Educational Enhancement Funding Corporation Revenue Bonds, Series 2013** | | | |
| 1,551 % fällig am 01.06.2016 | 500 | 501 | 0,08 |
| **Sacramento, California, Earthquake Authority Revenue Bonds, Series 2014** | | | |
| 1,824 % fällig am 01.07.2017 | 2.000 | 2.012 | 0,32 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| Travis, Texas, General Obligation Bonds, Series 2014 | | | | |
| 0,594 % fällig am 01.06.2017 | $ | 740 | $ 742 | 0,11 |
| | | | 3.255 | 0,51 |

| | | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|---|
| VORZUGSWERTPAPIERE | | | | |
| Citigroup Capital XIII | | | | |
| 6,692 % fällig am 30.10.2040 | | 4.500 | 117 | 0,02 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| US-SCHATZOBLIGATIONEN | | | | |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (c)(d) | $ | 17.875 | 17.660 | 2,79 |
| Summe USA | | | 395.626 | 62,59 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS (e) | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund | 1.074.986 | $ 10.752 | 1,70 |
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt | | $ 677.699 | 107,22 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month EURIBOR Interest Rate March Futures | Long | 03/2018 | 340 | $ 120 | 0,02 |
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2018 | 402 | 74 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2018 | 401 | 198 | 0,03 |
| 90-Day Sterling March Futures | Short | 03/2018 | 878 | 160 | 0,03 |
| Australia Government 3-Year Bond March Futures | Long | 03/2016 | 762 | 155 | 0,02 |
| US Treasury 5-Year Note March Futures | Short | 03/2016 | 150 | 60 | 0,01 |
| | | | | $ 767 | 0,12 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE | | | | | | |
| Call - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 128,000 | 19.02.2016 | 253 | $ 131 | $ 60 | 0,01 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE | | | | | | |
| Call - 90-Day Eurodollar December Futures | $ 98,750 | 19.12.2016 | 1.200 | $ (1.096) | $ (563) | (0,09) |
| Call - 90-Day Eurodollar June Futures | 98,750 | 13.06.2016 | 269 | (196) | (239) | (0,04) |
| Put - 90-Day Eurodollar December Futures | 98,750 | 19.12.2016 | 1.200 | (673) | (502) | (0,08) |
| | | | | $ (1.965) | $ (1.304) | (0,21) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (477)** | **(0,08)** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month Canadian Bank Bill | 1,000 % | 15.12.2017 | CAD 169.700 | $ 20 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | $ 16.200 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 % | 23.07.2019 | 37.380 | (340) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 23.000 | 98 | 0,02 |
| | | | | | $ (217) | (0,03) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (217)** | **(0,03)** |

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US Short-Term Fund (Forts.)

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Kingdom of Saudi Arabia | 1,000 % | 20.12.2020 | BRC | $ 700 | $ (17) | $ (18) | $ 1 | 0,00 |
| Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | BPS | 2.600 | (73) | (38) | (35) | (0,01) |
| Volvo Treasury AB | 1,000 % | 20.12.2020 | CBK | € 800 | (4) | (19) | 15 | 0,00 |
| Volvo Treasury AB | 1,000 % | 20.12.2020 | MYC | 800 | (3) | (15) | 12 | 0,00 |
| | | | | | $ (97) | $ (90) | $ (7) | (0,01) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | DKK | 25.000 | $ | 3.655 | HUS | $ 15 | $ 0 | $ 15 | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 9.218 | £ | 6.212 | JPM | 0 | (63) | (63) | (0,01) |
| 01/2016 | £ | 6.212 | $ | 9.365 | MSB | 210 | 0 | 210 | 0,03 |
| 01/2016 | JPY | 1.498.540 | | 12.268 | GLM | 0 | (189) | (189) | (0,03) |
| 01/2016 | $ | 6.454 | JPY | 796.000 | GLM | 163 | 0 | 163 | 0,03 |
| 01/2016 | | 5.802 | | 702.540 | MSB | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| 02/2016 | AUD | 2.444 | $ | 1.786 | CBK | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| 02/2016 | | 9.695 | | 6.953 | JPM | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| 02/2016 | CAD | 614 | | 463 | JPM | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| 02/2016 | CZK | 8.017 | | 333 | UAG | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| 02/2016 | € | 4.194 | | 4.540 | BOA | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| 02/2016 | | 2.569 | | 2.821 | CBK | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| 02/2016 | | 17.255 | | 18.575 | JPM | 0 | (187) | (187) | (0,03) |
| 02/2016 | $ | 416 | € | 388 | SCX | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 613 | | 570 | UAG | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| 02/2016 | £ | 116 | $ | 177 | CBK | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 02/2016 | | 6.212 | | 9.219 | JPM | 62 | 0 | 62 | 0,01 |
| 02/2016 | $ | 6.280 | JPY | 773.600 | JPM | 156 | 0 | 156 | 0,03 |
| 02/2016 | JPY | 882.900 | $ | 7.175 | JPM | 0 | (171) | (171) | (0,03) |
| 02/2016 | | 702.540 | | 5.806 | MSB | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| 03/2016 | MXN | 4.389 | | 254 | BRC | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 03/2016 | | 7.940 | | 464 | JPM | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| 07/2016 | BRL | 1.000 | | 303 | DUB | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| 07/2016 | | 22.000 | | 5.395 | MSB | 161 | 0 | 161 | 0,03 |
| | | | | | | $ 965 | $ (755) | $ 210 | 0,03 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 113** | **0,02** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 1,701 % fällig am 11.04.2016 | $ 1.600 | $ 1.601 | 0,25 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 1.601** | **0,25** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 678.719** | **107,38** |
| **TAGESGELDEINLAGEN** | | | |
| **ANZ National Bank** | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ 251 | $ 370 | 0,06 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 54 | 54 | 0,01 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD 333 | 243 | 0,04 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY 57 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 1.505 | 1.505 | 0,24 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | DKK 3 | 1 | 0,00 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY 1 | 0 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD 16 | 12 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ 1 | 2 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ 16 | 16 | 0,00 |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD 3 | 2 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 469 | $ 469 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 452 | 452 | 0,07 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,218 % fällig am 04.01.2016 | AUD | 195 | 142 | 0,02 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 570 | 410 | 0,07 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 112 | 122 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 24 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 79 | 117 | 0,02 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 11 | 11 | 0,00 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 3.929** | **0,62** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (50.600)** | **(8,00)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 632.048** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

(a) **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globale Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 55.429 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

(b) **Das Wertpapier ist in Verzug.**

(c) **Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.188 und Barmittel in Höhe von USD 115 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

(d) **Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

(e) **Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.**

(f) **Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) wurden zum 31. Dezember 2015 Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheit für OTC Swap- und Devisenkontrakte verpfändet.**

(g) **Barmittel in Höhe von USD 524 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

(h) **Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 10.869 | $ 663.536 | $ 3.294 | $ 677.699 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.601 | 0 | 1.601 |
| Finanzderivate[3] | (477) | (104) | 0 | (581) |
| **Summen** | **$ 10.392** | **$ 665.033** | **$ 3.294** | **$ 678.719** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2014 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 241 | $ 419.537 | $ 20 | $ 419.798 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.603 | 0 | 1.603 |
| Finanzderivate[3] | (1.081) | (303) | 0 | (1.384) |
| **Summen** | **$ (840)** | **$ 420.837** | **$ 20** | **$ 420.017** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

(i) **Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| RDR | 0,620 % | 24.12.2015 | 06.01.2016 | $ 12.148 | $ (12.149) | (1,92) |
| RDR | 0,620 % | 30.12.2015 | 06.01.2016 | 1.910 | (1.910) | (0,30) |
| RDR | 0,750 % | 18.12.2015 | 07.01.2016 | 9.871 | (9.874) | (1,56) |
| SOG | 0,750 % | 20.11.2015 | 20.01.2016 | 15.684 | (15.698) | (2,48) |
| SOG | 0,790 % | 20.11.2015 | 20.01.2016 | 13.327 | (13.347) | (2,12) |
| SOG | 0,790 % | 07.01.2016 | 20.01.2016 | 6.427 | (6.427) | (1,02) |
| | | | | | $ (59.405) | (9,40) |

**(j) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (20) | $ 0 | $ (20) |
| BPS | (73) | 0 | (73) |
| BRC | (16) | 0 | (16) |
| CBK | 40 | 0 | 40 |
| DUB | 65 | (10) | 55 |
| GLM | (26) | 0 | (26) |
| HUS | 15 | 0 | 15 |
| JPM | (263) | 260 | (3) |
| MSB | 371 | (370) | 1 |
| MYC | (3) | 0 | (3) |
| SCX | 6 | 0 | 6 |
| UAG | 17 | 0 | 17 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(k) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 107,22 | 109,55 |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | (0,08) | (0,28) |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,03) | (0,09) |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,02 | 0,01 |
| Summe Einlagenzertifikate | 0,25 | 0,42 |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## US Short-Term Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 39.350.906 | $ | 393.743 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.05.2017 | $ | 54.800 | | 54.719 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.03.2020 | | 47.900 | | 48.002 |
| US Treasury Notes 1,000 % fällig am 15.03.2018 | | 42.500 | | 42.702 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 30.327 | | 30.124 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 25.076 | | 25.362 |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2016 | | 25.000 | | 25.063 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.09.2020 | | 10.000 | | 10.044 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2020 | | 10.000 | | 9.854 |
| Japan Treasury Bills (0,035)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 1.080.000 | | 9.053 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 2,012 % fällig am 29.11.2023 | $ | 7.750 | | 7.881 |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 31.07.2020 | | 7.000 | | 7.055 |
| Japan Bank for International Cooperation 0,719 % fällig am 13.11.2018 | | 7.000 | | 6.997 |
| Japan Treasury Bills (0,002)% fällig am 01.06.2015 | JPY | 820.000 | | 6.870 |
| Sprint Communications, Inc. 6,000 % fällig am 01.12.2016 | $ | 6.700 | | 6.861 |
| Mylan, Inc. 1,800 % fällig am 24.06.2016 | | 6.500 | | 6.504 |
| Entergy Corp. 0,000 % fällig am 11.01.2016 | | 6.500 | | 6.485 |
| Actavis Funding SCS 1,757 % fällig am 12.03.2020 | | 6.200 | | 6.257 |
| Carefree Portfolio Trust 1,651 % fällig am 15.11.2019 | | 6.100 | | 6.092 |
| Penske Truck Leasing Co. LP 2,500 % fällig am 15.03.2016 | | 6.000 | | 6.046 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | | |
| PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 38.288.048 | $ | 383.100 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.05.2017 | $ | 54.800 | | 54.809 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.03.2020 | | 47.900 | | 48.004 |
| US Treasury Notes 1,000 % fällig am 15.03.2018 | | 42.500 | | 42.706 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 24.889 | | 25.505 |
| US Treasury Notes 0,625 % fällig am 31.12.2016 | | 25.000 | | 25.069 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | 12.431 | | 12.443 |
| Inflationsgeschützte Staatsanleihen 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | | 11.564 | | 11.820 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.09.2020 | | 10.000 | | 10.067 |
| US Treasury Notes 1,375 % fällig am 31.10.2020 | | 10.000 | | 9.859 |
| Japan Treasury Bills (0,035)% fällig am 28.12.2015 | JPY | 1.080.000 | | 9.059 |
| US Treasury Notes 1,625 % fällig am 31.07.2020 | $ | 7.000 | | 7.066 |
| Japan Treasury Bills (0,002)% fällig am 01.06.2015 | JPY | 820.000 | | 6.765 |
| Entergy Corp. 0,000 % fällig am 11.01.2016 | $ | 6.500 | | 6.495 |
| Hydro-Quebec 7,500 % fällig am 01.04.2016 | | 5.000 | | 5.160 |
| General Motors Financial Co., Inc. 2,750 % fällig am 15.05.2016 | | 5.000 | | 5.071 |
| CNOOC Finance 2013 Ltd. 1,125 % fällig am 09.05.2016 | | 5.000 | | 4.996 |
| Baggot Securities Ltd. 10,240 % fällig am 29.12.2049 | € | 4.000 | | 4.835 |
| Becton Dickinson & Co. 0,962 % fällig am 15.06.2016 | $ | 4.400 | | 4.407 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 3.100 | | 4.355 |

(a) Der US Short-Term Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Anlagen- und Vermögenswertportfolio des US Small Cap StocksPLUS™ Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE & GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 1,444 % fällig am 29.07.2020 | $ | 100 | $ 100 | 0,20 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KBC Bank NV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.01.2023 | | 400 | 437 | 0,88 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **Brazil Letras do Tesouro Nacional** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2016 | BRL | 3.440 | 780 | 1,57 |
| 0,000 % fällig am 01.01.2017 | | 110 | 24 | 0,05 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.05.2016 | $ | 100 | 99 | 0,20 |
| | | | 903 | 1,82 |
| **KANADA** | | | | |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 1,133 % fällig am 01.07.2020 | CAD | 958 | 685 | 1,38 |
| **Glencore Finance Canada Ltd.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 15.11.2016 | $ | 200 | 199 | 0,40 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,100 % fällig am 14.10.2020 | | 300 | 295 | 0,60 |
| | | | 1.179 | 2,38 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **Alibaba Group Holding Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 28.11.2017 | | 200 | 198 | 0,40 |
| **Doral CLO II Ltd.** | | | | |
| 1,657 % fällig am 26.05.2023 | | 670 | 669 | 1,35 |
| **Fortress Credit Investments IV Ltd.** | | | | |
| 1,565 % fällig am 17.07.2023 | | 972 | 972 | 1,96 |
| **Hutchison Whampoa Finance CI Ltd.** | | | | |
| 7,450 % fällig am 01.08.2017 | | 500 | 543 | 1,09 |
| **Vibrant CLO Ltd.** | | | | |
| 1,655 % fällig am 17.07.2024 | | 1.000 | 994 | 2,01 |
| | | | 3.376 | 6,81 |
| **CHINA** | | | | |
| **Amber Circle Funding Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.12.2017 | | 1.100 | 1.099 | 2,22 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 2,351 % fällig am 13.11.2017 | | 200 | 201 | 0,40 |
| 2,500 % fällig am 21.11.2017 | | 200 | 201 | 0,41 |
| **Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd.** | | | | |
| 1,101 % fällig am 10.04.2017 | | 600 | 599 | 1,21 |
| | | | 2.100 | 4,24 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **Czech Republic Ministry of Finance Bill** | | | | |
| (0,150 %) fällig am 02.09.2016 | CZK | 20.000 | 805 | 1,62 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 19.09.2033 | $ | 400 | 443 | 0,89 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **CNOOC Nexen Finance 2014 ULC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2017 | | 433 | 431 | 0,87 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 16.04.2016 | | 300 | 300 | 0,60 |
| | | | 731 | 1,47 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 1,507 % fällig am 20.10.2018 | | 300 | 303 | 0,61 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 1,056 % fällig am 23.07.2018 | | 500 | 499 | 1,01 |
| | | | 802 | 1,62 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Treasury Bills** | | | | |
| (0,085 %) fällig am 29.02.2016 | JPY | 270.000 | $ 2.245 | 4,53 |
| (0,080 %) fällig am 22.02.2016 | | 190.000 | 1.579 | 3,19 |
| (0,062 %) fällig am 07.03.2016 | | 390.000 | 3.242 | 6,54 |
| | | | 7.066 | 14,26 |
| Summe Japan | | | 7.868 | 15,88 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **Actavis Funding SCS** | | | | |
| 1,850 % fällig am 01.03.2017 | $ | 300 | 301 | 0,61 |
| 2,350 % fällig am 12.03.2018 | | 200 | 200 | 0,40 |
| | | | 501 | 1,01 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **Cooperatieve Centrale Raiffeisen-Boerenleenbank BA** | | | | |
| 8,400 % fällig am 29.11.2049 | | 200 | 216 | 0,44 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.03.2017 | | 200 | 201 | 0,41 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 | | 100.000 | 121 | 0,24 |
| | | | 538 | 1,09 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 1,625 % fällig am 14.07.2017 | $ | 700 | 697 | 1,41 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 27.10.2016 | | 600 | 612 | 1,23 |
| **Shinhan Bank** | | | | |
| 4,125 % fällig am 04.10.2016 | | 500 | 510 | 1,03 |
| | | | 1.819 | 3,67 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2049 | € | 200 | 204 | 0,41 |
| **Telefonica Emisiones SAU** | | | | |
| 3,192 % fällig am 27.04.2018 | $ | 200 | 204 | 0,41 |
| | | | 408 | 0,82 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 202 | 0,41 |
| 7,250 % fällig am 22.02.2022 | | 300 | 314 | 0,63 |
| | | | 516 | 1,04 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 400 | 456 | 0,92 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 02.05.2036 | | 300 | 359 | 0,73 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 29.12.2049 | £ | 200 | 310 | 0,62 |
| **Newgate Funding** | | | | |
| 0,733 % fällig am 01.12.2050 | | 300 | 394 | 0,79 |
| **Royal Bank of Scotland PLC** | | | | |
| 9,500 % fällig am 16.03.2022 | $ | 300 | 325 | 0,66 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,786 % fällig am 15.07.2051 | £ | 100 | 146 | 0,30 |
| | | | 1.990 | 4,02 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 0,602 % fällig am 15.06.2024 | $ | 132 | 131 | 0,26 |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 0,560 % fällig am 05.01.2016 | | 600 | 600 | 1,21 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 0,551 % fällig am 26.01.2016 | | 800 | 799 | 1,61 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hewlett-Packard Co.** | | | | |
| 0,701 % fällig am 08.01.2016 | $ | 400 | $ 400 | 0,81 |
| **Hitachi Capital America Corp.** | | | | |
| 0,720 % fällig am 04.01.2016 | | 800 | 800 | 1,62 |
| | | | 2.599 | 5,25 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 14.05.2018 | | 100 | 100 | 0,20 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 21.05.2018 | | 300 | 301 | 0,61 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 0,932 % fällig am 31.07.2018 | | 600 | 598 | 1,21 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2018 | | 600 | 626 | 1,26 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,533 % fällig am 30.06.2020 | | 100 | 99 | 0,20 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.06.2019 | | 600 | 695 | 1,40 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 17.08.2020 | | 200 | 201 | 0,41 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,630 % fällig am 26.10.2020 | | 400 | 404 | 0,81 |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 100 | 99 | 0,20 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 20.07.2018 | | 100 | 100 | 0,20 |
| **Daimler Finance N.A. LLC** | | | | |
| 1,044 % fällig am 03.08.2017 | | 300 | 300 | 0,60 |
| **Duke Energy Progress LLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2021 | | 600 | 612 | 1,24 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,240 % fällig am 15.06.2018 | | 300 | 297 | 0,60 |
| 4,250 % fällig am 03.02.2017 | | 600 | 613 | 1,24 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 1,048 % fällig am 22.05.2017 | | 1.000 | 999 | 2,02 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 1,114 % fällig am 07.08.2018 | | 100 | 100 | 0,20 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.08.2016 | | 600 | 601 | 1,21 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,529 % fällig am 29.10.2020 | | 200 | 202 | 0,41 |
| 2,250 % fällig am 23.01.2020 | | 30 | 30 | 0,06 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.07.2018 | | 100 | 100 | 0,20 |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 200 | 200 | 0,40 |
| **Metropolitan Life Global Funding I** | | | | |
| 0,851 % fällig am 15.07.2016 | | 200 | 200 | 0,40 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 8,450 % fällig am 15.06.2018 | | 300 | 316 | 0,64 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 0,666 % fällig am 23.05.2016 | | 600 | 601 | 1,21 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 6,650 % fällig am 15.03.2017 | | 700 | 723 | 1,46 |
| **State Street Corp.** | | | | |
| 1,264 % fällig am 18.08.2020 | | 600 | 601 | 1,21 |
| **Wyndham Worldwide Corp.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2017 | | 500 | 503 | 1,02 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 30 | 30 | 0,06 |
| | | | 10.251 | 20,68 |
| **MORTGAGE-BACKED SECURITIES** | | | | |
| **Alternative Loan Trust** | | | | |
| 0,743 % fällig am 20.11.2035 | | 15 | 12 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 0,612 % fällig am 25.09.2046 (a) | | 190 | 137 | 0,28 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,842 % fällig am 25.10.2035 | | 42 | 42 | 0,09 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 0,552 % fällig am 25.07.2037 | | 200 | 187 | 0,38 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 1,042 % fällig am 25.12.2035 | | 297 | 282 | 0,57 |
| **GMACM Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,444 % fällig am 19.07.2035 | | 23 | 20 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖ-GENS |
|---|---|---|---|
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,000 % fällig am 25.05.2037 (a) | $ 13 | $ 11 | 0,02 |
| **Harborview Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,612 % fällig am 19.11.2036 | 139 | 105 | 0,21 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 0,682 % fällig am 25.05.2037 | 100 | 80 | 0,16 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 2,566 % fällig am 25.04.2036 (a) | 230 | 212 | 0,43 |
| **Lavender Trust** | | | |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036 | 239 | 249 | 0,50 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 0,542 % fällig am 25.08.2036 (a) | 349 | 268 | 0,54 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2033 | 49 | 51 | 0,10 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 0,622 % fällig am 25.03.2037 | 1.000 | 469 | 0,95 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.09.2022 (a) | 9 | 9 | 0,02 |
| **Reperforming Loan REMIC Trust** | | | |
| 5,543 % fällig am 25.01.2034 | 43 | 43 | 0,09 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2034 | $ 165 | $ 174 | 0,35 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 0,997 % fällig am 25.01.2047 (a) | 149 | 121 | 0,24 |
| | | 2.472 | 4,99 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 1,129 % fällig am 25.11.2022 | 400 | 401 | 0,81 |
| 3,000 % fällig am 25.10.2040 | 229 | 235 | 0,47 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,190 % fällig am 06.01.2016 | 300 | 300 | 0,60 |
| 0,236 % fällig am 27.01.2016 | 900 | 900 | 1,82 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 1,420 % fällig am 01.01.2066 | 300 | 302 | 0,61 |
| | | 2.138 | 4,31 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 | 1.320 | 1.304 | 2,63 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (c) | $ 1.607 | $ 1.535 | 3,10 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 - 15.07.2025 | 1.056 | 1.024 | 2,07 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 505 | 442 | 0,89 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 (d)(e) | 6.900 | 6.811 | 13,74 |
| **US Treasury Notes (d)** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 - 31.07.2020 (c)(e) | 13.400 | 13.341 | 26,92 |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 | 2.100 | 2.067 | 4,17 |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | 3.200 | 3.192 | 6,44 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | 3.900 | 3.892 | 7,85 |
| | | 33.608 | 67,81 |
| Summe USA | | 51.199 | 103,30 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 74.913** | **151,14** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2016 | 81 | $ (34) | (0,07) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2017 | 48 | (47) | (0,09) |
| Russell 2000 Mini Index March Futures | Long | 03/2016 | 437 | 477 | 0,96 |
| US Treasury 10-Year Note March Futures | Long | 03/2016 | 24 | 9 | 0,02 |
| US Treasury 20-Year Bond March Futures | Short | 03/2016 | 16 | (4) | (0,01) |
| | | | | $ 401 | 0,81 |

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | $ 108,000 | 19.02.2016 | 30 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - US Treasury 10-Year Note March Futures | 108,500 | 19.02.2016 | 31 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **OPTIONEN AUF ROHSTOFFTERMINKONTRAKTE** | | | | | | |
| Call - Euro-Bund 10-Year Bond February Futures | € 160,000 | 22.01.2016 | 8 | $ (5) | $ (2) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ 400** | **0,81** |

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

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 16.12.2018 | $ 6.000 | $ (35) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | 1.700 | (28) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 16.12.2022 | 16.900 | (362) | (0,73) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,350 % | 02.10.2025 | 1.700 | (31) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 % | 28.10.2025 | 500 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,840 % | 28.10.2025 | 700 | (3) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,050 % | 28.10.2025 | 400 | (6) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,150 % | 16.12.2025 | 375 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,215 % | 05.02.2026 | 700 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 15.06.2026 | 3.300 | 11 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 % | 16.12.2045 | 100 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,680 % | 14.09.2046 | 340 | 4 | 0,01 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,810 % | 14.09.2046 | $ 600 | $ 10 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 % | 16.03.2026 | £ 200 | 4 | 0,01 |
| | | | | | $ (437) | (0,88) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (437)** | **(0,88)** |

**FREIVERKEHRSFINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**OPTIONSKAUF**

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,358 % | 30.12.2016 | $ 6.000 | $ 16 | $ 16 | 0,03 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,100 % | 14.03.2016 | 3.800 | 47 | 61 | 0,12 |
| Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | JPM | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,350 % | 12.09.2016 | 1.200 | 33 | 13 | 0,03 |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,750 % | 03.02.2016 | 5.100 | 9 | 1 | 0,00 |
| Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,500 % | 06.04.2016 | 51.700 | 47 | 1 | 0,00 |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,500 % | 06.09.2016 | 7.500 | 54 | 29 | 0,06 |
| | | | | | | | $ 206 | $ 121 | 0,24 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Kontrahent | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **CREDIT DEFAULT SWAPTIONS** | | | | | | | | |
| Put - CDX.IG 25-Index | BRC | Verkauf | 1,250 % | 16.03.2016 | $ 100 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG 25-Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 20.01.2016 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG 25-Index | JPM | Verkauf | 1,100 % | 17.02.2016 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CDX.IG 25-Index | JPM | Verkauf | 1,200 % | 17.02.2016 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1) | $ 0 | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **DEVISENOPTIONEN** | | | | | | | |
| Call - OTC Euro versus US dollar | SCX | $ 1,111 | 07.01.2016 | € 1.000 | $ (7) | $ 0 | 0,00 |
| Put - OTC US dollar versus Brazilian real | FBF | BRL 3,800 | 27.01.2016 | $ 200 | (3) | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (10) | $ (2) | 0,00 |

| Beschreibung | Kontrahent | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **ZINSSWAPOPTIONEN** | | | | | | | | | |
| Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | CBK | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,000 % | 30.12.2016 | $ 1.300 | $ (16) | $ (17) | (0,03) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,610 % | 14.03.2016 | 3.800 | (19) | (13) | (0,03) |
| Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | DUB | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,855 % | 14.03.2016 | 3.800 | (28) | (32) | (0,06) |
| Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,500 % | 03.02.2016 | 5.100 | (27) | (6) | (0,01) |
| Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | MYC | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,272 % | 06.09.2016 | 1.700 | (54) | (32) | (0,07) |
| | | | | | | | $ (144) | $ (100) | (0,20) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Kontrahent | Nennbetrag[2] | Marktwert | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | BPS | € 100 | $ (1) | $ (2) | $ 1 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 % | 20.12.2017 | JPM | 200 | (1) | (4) | 3 | (0,01) |
| | | | | | $ (2) | $ (6) | $ 4 | (0,01) |

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

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Kontrahent | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 01/2016 | CNY | 1.717 | $ | 265 | DUB | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,01 |
| 01/2016 | $ | 1.334 | £ | 899 | CBK | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| 01/2016 | £ | 899 | $ | 1.355 | MSB | 30 | 0 | 30 | 0,06 |
| 01/2016 | $ | 709 | INR | 47.065 | CBK | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 01/2016 | INR | 47.041 | $ | 708 | UAG | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| 01/2016 | $ | 3.934 | JPY | 482.100 | BOA | 74 | 0 | 74 | 0,15 |
| 01/2016 | JPY | 144.400 | $ | 1.177 | BOA | 0 | (24) | (24) | (0,05) |
| 01/2016 | $ | 752 | JPY | 92.400 | CBK | 16 | 0 | 16 | 0,03 |
| 01/2016 | JPY | 430.100 | $ | 3.543 | CBK | 0 | (32) | (32) | (0,06) |
| 02/2016 | CAD | 964 | | 726 | MSB | 32 | 0 | 32 | 0,06 |
| 02/2016 | $ | 392 | € | 358 | BOA | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| 02/2016 | € | 399 | $ | 435 | BOA | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 02/2016 | | 545 | | 583 | CBK | 0 | (10) | (10) | (0,02) |
| 02/2016 | | 685 | | 737 | JPM | 0 | (8) | (8) | (0,02) |
| 02/2016 | $ | 653 | £ | 430 | BOA | 0 | (19) | (19) | (0,04) |
| 02/2016 | £ | 899 | $ | 1.334 | CBK | 9 | 0 | 9 | 0,02 |
| 02/2016 | | 97 | | 146 | JPM | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| 02/2016 | | 3 | | 5 | MSB | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| 02/2016 | JPY | 482.100 | | 3.937 | BOA | 0 | (75) | (75) | (0,15) |
| 02/2016 | | 270.000 | | 2.200 | CBK | 0 | (47) | (47) | (0,09) |
| 02/2016 | | 190.000 | | 1.550 | JPM | 0 | (31) | (31) | (0,06) |
| 02/2016 | $ | 3.918 | JPY | 482.100 | JPM | 93 | 0 | 93 | 0,19 |
| 03/2016 | JPY | 195.000 | $ | 1.591 | BOA | 0 | (32) | (32) | (0,06) |
| 03/2016 | | 195.000 | | 1.590 | BPS | 0 | (33) | (33) | (0,07) |
| 09/2016 | CZK | 20.030 | | 835 | JPM | 19 | 0 | 19 | 0,04 |
| 10/2016 | BRL | 200 | | 48 | BPS | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| 10/2016 | | 1.100 | | 263 | CBK | 10 | 0 | 10 | 0,02 |
| 10/2016 | | 1.430 | | 341 | JPM | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| 10/2016 | | 710 | | 174 | MSB | 10 | 0 | 10 | 0,02 |
| 01/2017 | | 110 | | 26 | DUB | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 314 | $ (324) | $ (10) | (0,02) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 7** | **0,01** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae TBA (g)** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.01.2046 | $ | (700) | $ (700) | (1,41) |
| 3,500 % fällig am 15.01.2046 | | (1.300) | (1.341) | (2,71) |
| 4,000 % fällig am 01.01.2046 | | (1.400) | (1.482) | (2,99) |
| | | | $ (3.523) | (7,11) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | | **$ (3.523)** | **(7,11)** |
| **Summe Anlagen** | | | **$ 71.360** | **143,97** |

## TAGESGELDEINLAGEN

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **ANZ National Bank** | | | | |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 5 | $ 7 | 0,01 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 35 | 35 | 0,07 |
| **Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd.** | | | | |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 48 | 0 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 955 | 955 | 1,93 |
| **Brown Brothers Harriman & Co.** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 1 | 1 | 0,00 |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 10 | 10 | 0,02 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 298 | 298 | 0,60 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | | 287 | 287 | 0,58 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,050 % fällig am 04.01.2016 | CAD | 28 | 20 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.01.2016 | € | 8 | 9 | 0,02 |
| 0,005 % fällig am 04.01.2016 | JPY | 20 | 0 | 0,00 |
| 0,075 % fällig am 04.01.2016 | £ | 1 | 2 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank** | | | | |
| 0,090 % fällig am 04.01.2016 | $ | 7 | 7 | 0,01 |
| **Summe Tagesgeldeinlagen** | | | **$ 1.631** | **3,29** |
| **Sonstige Aktiva & Passiva** | | | **$ (23.427)** | **(47,26)** |
| **Nettovermögen** | | | **$ 49.564** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUM ANLAGEN- UND VERMÖGENSWERTPORTFOLIO (Angaben in Tausend*):

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

**(a) Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.511 und Barmittel in Höhe von USD 60 wurden verpfändet, um erforderliche Einschüsse für die offenen Terminkontrakte per 31. Dezember 2015 abzudecken.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte vom 31. Dezember 2015 wurden Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 22.513 als Sicherheit für ein ursprüngliches Sicherungsgut und/oder zusätzliches Sicherungsgut für Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verwendet.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 31. Dezember 2015 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 4.317 als Sicherheiten für verzögert gelieferte Wertpapiere und/oder Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte verpfändet oder geliefert.**

**(f) Barmittel in Höhe von USD 593 wurden zum 31. Dezember 2015 als Sicherheit für zentral abgerechnete Swaps verpfändet.**

**(g) Zum 31. Dezember 2015 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.**

**(h) Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 121 | $ 74.490 | $ 302 | $ 74.913 |
| Finanzderivate[3] | 400 | (430) | 0 | (30) |
| Leerverkäufe | 0 | (3.523) | 0 | (3.523) |
| **Summen** | **$ 521** | **$ 70.537** | **$ 302** | **$ 71.360** |

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

(2) Weitere Informationen finden Sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio.

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

**(i) Rückkaufvereinbarungen zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdat | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | (0,200 %) | 23.11.2015 | 04.01.2016 | $ 1.700 | $ (1.700) | (3,43) |
| SCX | 0,410 % | 30.10.2015 | 25.01.2016 | 2.124 | (2.125) | (4,29) |
| SCX | 0,440 % | 06.11.2015 | 04.03.2016 | 1.506 | (1.507) | (3,04) |
| SCX | 0,530 % | 13.11.2015 | 12.02.2016 | 3.805 | (3.807) | (7,68) |
| SCX | 0,560 % | 17.11.2015 | 19.01.2016 | 4.796 | (4.799) | (9,68) |
| SCX | 0,570 % | 20.11.2015 | 21.01.2016 | 3.861 | (3.863) | (7,80) |
| SCX | 0,580 % | 11.12.2015 | 11.02.2016 | 993 | (993) | (2,00) |
| SCX | 0,590 % | 01.12.2015 | 12.01.2016 | 1.715 | (1.716) | (3,46) |
| SGY | 0,150 % | 21.12.2015 | 15.01.2016 | 2.211 | (2.211) | (4,46) |
| | | | | | $ (22.721) | (45,84) |

**(j) Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 31. Dezember 2015:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 0,708 % | 22.12.2015 | 21.03.2016 | $ 1.991 | $ (2.001) | (4,04) |
| TDM | 1,236 % | 18.12.2015 | 14.01.2016 | 2.361 | (2.364) | (4,77) |
| | | | | | $ (4.365) | (8,81) |

(1) n dem für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 7 für einen aufgeschobenen Kursrückgang für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte enthalten.

**(k) Sicherheiten (erhalten) verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 31. Dezember 2015.

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Nettoengagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (78) | $ 0 | $ (78) |
| BPS | (33) | 0 | (33) |
| CBK | (63) | 0 | (63) |
| DUB | 20 | (10) | 10 |
| FBF | (2) | 0 | (2) |
| JPM | 99 | 0 | 99 |
| MSB | 72 | 0 | 72 |
| MYC | (7) | 0 | (7) |
| UAG | (1) | 0 | (1) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären. Weitere Informationen zum Kredit- und Kontrahentenrisiko finden Sie in Erläuterung 15, Finanzielle Risiken, in den Erläuterungen zum Abschluss.

**(l) Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für das Anlagen- und Vermögenswertportfolio zum 31. Dezember 2015.

| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| Summe Übertragbare Wertpapiere & Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt | 151,14 | k. A. |
| Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate | 0,81 | k. A. |
| Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate | (0,88) | k. A. |
| Summe Freiverkehrsfinanzderivate | 0,01 | k. A. |
| Summe Leerverkaufte Wertpapiere | (7,11) | k. A. |

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des
## US Small Cap StocksPLUS™ Fund

31. Dezember 2015 (ungeprüft)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 | $ | 28.400 | $ 28.008 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 22.700 | 22.404 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 31.07.2020 | | 7.700 | 7.775 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,022)% fällig am21.12.2015 | JPY | 850.000 | 7.031 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 24.09.2015 | | 850.000 | 6.911 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | $ | 5.700 | 5.682 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | | 4.000 | 3.940 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | | 3.900 | 3.871 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.12.2015 | JPY | 430.000 | 3.566 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.09.2015 | | 430.000 | 3.496 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | $ | 3.200 | 3.232 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a) | | 3.170 | 3.222 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,062)% fällig am07.03.2016 | JPY | 390.000 | 3.159 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,080)% fällig am22.02.2016 | | 380.000 | 3.093 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a) | $ | 2.752 | 2.732 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 1.900 | 2.622 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,085)% fällig am29.02.2016 | JPY | 270.000 | 2.187 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.07.2015 | $ | 2.000 | 2.000 |
| **Deutsche Telekom** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.08.2015 | | 1.700 | 1.699 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 1,048 % fällig am 22.05.2017 | | 1.600 | 1.600 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 31. DEZEMBER 2015** | | | |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 | $ | 26.300 | $ 25.812 |
| **US Treasury Bonds** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 15.800 | 15.801 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| (0,022)% fällig am21.12.2015 | JPY | 850.000 | 6.892 |
| **US Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | $ | 4.000 | 3.880 |
| **Japan Treasury Bills** | | | |
| 0,000 % fällig am 14.12.2015 | JPY | 430.000 | 3.550 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2024 | € | 1.900 | 2.574 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a) | $ | 1.610 | 1.551 |
| **Inflationsgeschützte Staatsanleihen** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a) | | 1.426 | 1.428 |
| **Babson CLO Ltd.** | | | |
| 1,561 % fällig am 15.05.2023 | | 1.300 | 1.295 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,095 % fällig am 07.08.2015 | | 1.100 | 1.100 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 23.10.2015 | | 1.100 | 1.100 |
| **Commercial Industrial Finance Corporation Funding Ltd.** | | | |
| 1,802 % fällig am 05.12.2024 | | 1.000 | 997 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2016 | | 900 | 900 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2015 | | 900 | 900 |
| **Fraser Sullivan CLO VII Ltd.** | | | |
| 1,362 % fällig am 20.04.2023 | | 849 | 846 |
| **Glencore Finance Canada Ltd.** | | | |
| 5,800 % fällig am 15.11.2016 | | 800 | 772 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,019 % fällig am 11.06.2015 | | 700 | 700 |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 0,000 % fällig am 11.01.2016 | | 700 | 700 |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 | | 600 | 683 |
| **US Treasury Bills** | | | |
| 0,022 % fällig am 03.09.2015 | | 681 | 681 |

(a) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Tagesgeldanlagen nicht angelegter Teilfondsbarmittel, die gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Teilfonds (nachfolgend jeweils als „Teilfonds" und gemeinsam als die „Teilfonds" bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft"), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Teilfonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank") nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW")) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien") genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich insofern um eine Gesellschaft des Umbrellatyps, als zu gegebener Zeit Investmentanteilsklassen mit Bezug auf unterschiedliche Teilfonds ausgegeben werden können. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat") dürfen für einen Teilfonds mehrere Anteilsklassen („Klassen") ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Teilfonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Teilfonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Teilfonds auflegen. Darüber hinaus darf der Verwaltungsrat zu gegebener Zeit weitere Klassen einrichten. Er muss die Zentralbank vorab darüber informieren und diese Klassen von ihr freigeben lassen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet. Die Finanzdaten, einschließlich der Wertpapierbeschreibungen, die im Anlagen- und Vermögenswertportfolio offengelegt werden, enthalten Daten in US-Format, da die Mehrheit der Wertpapiere an US-Börsen (die „lokale Börsen") gehandelt wird und die Präsentationswährung der Gesellschaft der US-Dollar ist.

PIMCO Europe Ltd. wurde für den Global Advantage Fund, Global Bond Fund, Global Bond Ex-US Fund und Global Multi-Asset Fund zur diskretionären Unter-Anlageberatungsgesellschaft bestellt.

Parametric Portfolio Associates, LLC wurde damit beauftragt, Unterstützung bei der Umsetzung der Anlagepolitik des PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, des PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund und des PIMCO RAE Fundamental US Fund zu bieten und verfügt über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis. In dieser Hinsicht verfügt Parametric Portfolio Associates, LLC über eine Ermessensbefugnis, für die bestimmte Parameter und Einschränkungen gelten, die zwischen der Anlageberatungsgesellschaft und Research Affiliates, LLC vereinbart wurden. Research Affiliates, LLC wurde zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit Ermessensbefugnis bezüglich der oben erwähnten Fonds bestellt.

Research Affiliates, LLC wurde für den PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund, den PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund und den PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft ohne Entscheidungsbefugnis bestellt.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Es folgt eine Zusammenfassung der wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und der Schätzungstechniken, die von der Gesellschaft angewandt und beim Aufstellen dieses Abschlusses verwendet werden:

**(a) Erstellungsgrundlage** Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen, einschließlich Financial Reporting Standard („FRS") 102: „The financial reporting standard applicable in the UK and Republic of Ireland", dem irischen Gesetz, das den Companies Act 2014 umfasst, und den OGAW-Richtlinien erstellt. FRS 102 gilt für Rechnungslegungszeiträume, die am oder nach dem 1. Januar 2015 beginnen. Dieser Abschluss ist der erste Jahresabschluss, der die Anforderungen von FRS 102 erfüllt. Der Abschluss wurde für das Geschäftsjahr (der „Berichtszeitraum") zum 31. Dezember 2015 erstellt. Der Übergang zu FRS 102 hat eine Änderung der Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden bezüglich der Bewertung zur Folge gehabt. Nähere Einzelheiten hierzu sind Erläuterung 2(b) zu entnehmen. An bisher ausgewiesenen Beträgen wurden bestimmte Umbuchungen vorgenommen, damit diese mit der Präsentation dieses Jahres übereinstimmen. Diese Umbuchungen, die in Erläuterung 2(b) näher dargestellt sind, hatten keine Auswirkungen auf das ausgewiesene Handelsnettovermögen der Anteilinhaber. Die in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden für das Aufstellen des Abschlusses hat das Institute of Chartered Accountants in Irland veröffentlicht und das Financial Reporting Council („FRC") hat diese herausgegeben. Der Abschluss wird für alle Teilfonds, mit Ausnahme des PIMCO Asia Local Bond Fund, des PIMCO Emerging Multi-Asset Fund, des PIMCO Eqs Emerging Markets Fund, des PIMCO EqS Pathfinder Fund™ und des PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™, deren Anteile im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2015 vollständig zurückgenommen wurden, auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellt.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Meinung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der Ausnahme keine Kapitalflussrechnung zu erstellen Gebrauch gemacht, die offenen Investmentfonds nach FRS 102 zur Verfügung steht.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Gesellschaft führt für jeden Teilfonds gesonderte Konten. Anteile werden von der Gesellschaft ausgegeben und dem Teilfonds zugewiesen, den der Anteilinhaber auswählt. Der Erlös aus der Ausgabe und der daraus entstehende Ertrag werden jeder Teilfondsklasse im Verhältnis zu der gesamten Bewertung jeder Klasse gutgeschrieben. Bei der Rücknahme haben Anteilinhaber nur Anspruch auf ihren Teil des am Teilfonds gehaltenen Nettovermögens, für den Anteile an sie ausgegeben wurden.

Die Zahlen im Abschluss wurden auf Tausend gerundet, es sei denn, im Bericht werden anders lautende Angaben gemacht.

**(b) Ermittlung des Nettoinventarwerts** Der Nettoinventarwert (der „NIW") jedes Teilfonds und/oder jeder Anteilsklasse wird, wie im aktuell gültigen Verkaufsprospekt der Gesellschaft bzw. in der jeweiligen Ergänzung offengelegt, mit dem Schluss des regulären Handels an jedem Handelstag berechnet.

Die Gesellschaft hat beschlossen, die auf den Ansatz und die Bewertung bezogenen Bestimmungen von International Accounting Standard („IAS") 39 Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung sowie die Angabe- und Darstellungspflichten gemäß FRS 102 für die Bilanzierung ihrer Finanzinstrumente anzuwenden. Gemäß IAS 39 wurden Wertpapiere der Teilfonds sowie andere Vermögenswerte zum zuletzt gehandelten Kurs am 31. Dezember 2015 bewertet, um das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber (das „Nettovermögen") zu bestimmen.

Für den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2014 wurden die Wertpapiere der Teilfonds sowie andere Vermögenswerte gemäß FRS 26 „Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung" zum Angebotsschlusskurs bewertet, um das Nettovermögen des Emerging Markets Bond Fund und des Emerging Markets Corporate Bond Fund zu ermitteln. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten wurden neu ausgewiesen, um den Übergang vom Geld- zum letzten Handelskurs gemäß IAS 39 zu berücksichtigen. Die Anpassungen zur Überleitung der zum Geldkurs bewerteten Vermögenswerte zum Handels-NIW gemäß Betriebsergebnisrechnung gestalteten sich wie folgt (Angaben in Tausend):

| Teilfonds | FRS 102 Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr | FRS 26 Am 31. Dez. 2014 abgeschlossenes Jahr |
|---|---|---|
| Emerging Markets Bond Fund | - | $ 23.660 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | - | $ 6.908 |
| Income Fund | - | $ (22.540) |

**(c) Wertpapiertransaktionen und Anlageerträge** Wertpapiertransaktionen werden zum Handelstag zum Zwecke der Finanzberichterstattung ausgewiesen. Wertpapiere, die auf der Basis des Emissionstermins oder der verzögerten Lieferung gekauft oder verkauft werden, können 15 Tage oder länger nach dem Handelstag abgerechnet werden. Realisierte Gewinne und Verluste aus Wertpapierverkäufen werden auf der Basis der festgestellten Kosten erfasst. Dividendeneinkünfte werden zum Ex-Dividende-Datum erfasst; ausgenommen hiervon sind bestimmte Dividenden von ausländischen Wertpapieren, bei denen das Ex-Dividende-Datum möglicherweise bereits verstrichen ist. Diese werden erfasst, sobald der Teilfonds Informationen über das Ex-Dividende-Datum erhält. Um Disagios und Prämienabschreibungen bereinigte Zinseinkünfte werden auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst und mithilfe effektiver Zinsverfahren berechnet. Für wandelbare Wertpapiere werden Aufschläge, die dem Wandlungsrecht zuzuordnen sind, nicht abgeschrieben. Geschätzte Steuerverbindlichkeiten auf bestimmte ausländische Wertpapiere werden auf Rechnungsabgrenzungsbasis erfasst und als Bestandteile der Zinseinkünfte bzw. als Quellensteuern auf Dividenden und anderen Anlageertrag in der Betriebsergebnisrechnung wiedergegeben.

**(d) Mehrfach-Klassen-Zuordnungen** Wenn nicht anders angegeben, verfügen sämtliche von der Gesellschaft angebotenen Klassen in Bezug auf Vermögenswerte und Stimmprivilegien über gleiche Rechte (außer bei Anteilinhabern einer Klasse,

die über ausschließliche Stimmrechte in Bezug auf Angelegenheiten verfügen, die ausschließlich diese Klasse betreffen). Innerhalb jeder Klasse eines jeden Teilfonds darf die Gesellschaft entweder teilweise oder nur ausschüttende Anteile (Einkommen ausschüttende Anteile), thesaurierende Anteile (Einkommen thesaurierende Anteile) und Income II-Anteile (eine erhöhte Rendite ausschüttende Anteile) ausgeben. Aufgrund der Mehrfach-Klassen-Struktur kann der Anleger das Anteilserwerbsverfahren wählen, das ihm unter Berücksichtigung der zu erwerbenden Menge, des Zeitraums, für den der Anleger die Anteile halten möchte, sowie der sonstigen Umstände am vorteilhaftesten scheint. Sind Anteile abweichender Klassen oder Emissionen im Umlauf, kann der NIW je Anteil zwischen den Klassen abweichen, um die Tatsache wiederzugeben, dass das Einkommen thesauriert oder ausgeschüttet wurde, oder für sie können unterschiedliche Gebühren und Aufwendungen anfallen. Realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge und -verluste der einzelnen Teilfonds werden jeder Anteilsklasse täglich auf der Basis des relativen Nettovermögens der einzelnen Klassen des betreffenden Teilfonds zugewiesen.

**(e) Barmittel und Fremdwährung** Die Abschlüsse der einzelnen Teilfonds werden unter Zuhilfenahme der hauptsächlichen Wirtschaftsumgebung, in der sie ihre Geschäftstätigkeit ausüben, erstellt (die „Funktionswährung"). Die Funktions- und Berichtswährungen der Teilfonds der Gesellschaft sind identisch.

Bestimmte Teilfonds besitzen mehrere Klassen mit ausländischen Anteilen, die in der Fremdwährung dargestellt werden, und in der die betreffenden Klassen ihre Geschäftstätigkeit ausüben, und sie gelten bei der Bewertung der Abschlüsse als Fremdwährungen.

Die Präsentationswährung für die Finanzabschlüsse ist hauptsächlich der US-Dollar, mit Ausnahme bestimmter Teilfonds, die auf Euro oder Pfund Sterling lauten. Die Gesellschaftssummen der Teilfonds, die durch das irische Gesellschaftsrecht vorgeschrieben werden, lauten auf US-Dollar, da diese Währung das vorherrschende wirtschaftliche Umfeld der Gesellschaft darstellt. Falls nicht anders angegeben, sind alle Beträge in US-Dollar ausgewiesen.

Die Marktwerte der ausländischen Wertpapiere, Währungspositionen und sonstigen Aktiva und Passiva werden auf Basis der am jeweiligen Tag geltenden Umtauschkurse in die Funktionswährung des jeweiligen Teilfonds umgerechnet. Schwankungen im Wert der Währungsbeteiligungen und sonstigen Aktiva und Passiva aus Veränderungen der Wechselkurse werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Fremdwährungen erfasst.

Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus der Umrechnung von Wertpapieren, die auf Fremdwährungen lauten, sind in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren enthalten. Realisierte Gewinne und Verluste zwischen den Transaktions- und Abwicklungsdaten aus dem Erwerb und Verkauf von auf Fremdwährung lautenden Wertpapieren sind im realisierten Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungen in der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

Bestimmte Teilfonds verfügen über eine besicherte Klasse, die Devisenkontrakte eingeht, die dazu bestimmt sind, den Absicherungseffekt auf Teilfondsebene glattzustellen, damit sich die Funktionswährung (die „besicherten Klassen") weiter an anderen Währungen als der Funktionswährung beteiligen kann.

Bei den Hedged Classes (abgesicherten Anteilsklassen) möchte die Gesellschaft gemäß den Bestimmungen und Auslegungen, die die Zentralbank jeweils bekannt gibt, diese gegen Schwankungen der Währungen, auf die die Hedged Classes lauten, gegenüber anderen Währungen absichern. Die abgesicherten Klassen sind im Ergebnis dieser Transaktionen keinem Hebel ausgesetzt. Obwohl sich die Gesellschaft bemüht, das Währungsrisiko abzusichern, besteht keine Garantie, dass sie damit Erfolg haben wird. Absicherungstransaktionen sind eindeutig einer bestimmten Klasse zuzuordnen. Alle Kosten und Gewinne/Verluste dieser Absicherungsstrategien können den Nutzen für Anteilinhaber der betreffenden besicherten Anteilsklasse beträchtlich einschränken, wenn die Klassenwährung gegenüber der Funktionswährung und/oder der Währung fällt, auf die einige oder alle Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds lauten. Die Gesellschaft darf jeweils nach eigenem Ermessen und nach vorheriger Mitteilung an und Genehmigung durch die Zentralbank zusätzliche Anteilsklassen ausgeben, die auf andere Währungen lauten oder gegenüber diesen abgesichert sind.

Der Finanzstatus wird mithilfe von Wechselkursen zum Ende des Berichtszeitraums umgerechnet und die Betriebsergebnisrechnung und der Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen werden zum durchschnittlichen Wechselkurs des Berichtszeitraums umgerechnet, um diese in den gemeinsamen Abschluss der Gesellschaft einzubeziehen. Das Umrechnungsverfahren übt keinerlei Einfluss auf den Wert des Nettovermögens der einzelnen Teilfonds aus.

**(f) Transaktionskosten** Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen oder -verbindlichkeiten zu erwerben. Zu ihnen zählen an Mittler, Berater, Makler und Händler gezahlte Gebühren und Provisionen. Transaktionskosten werden in der Betriebsergebnisrechnung unter dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten, dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten, dem realisierten Nettogewinn/(-verlust) und der Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Devisen erfasst. Bei Rentenwerten und bestimmten Derivaten können Transaktionskosten nicht aus dem Kaufpreis des Wertpapiers herausgezogen werden, weshalb sie nicht separat ausgewiesen werden können.

**(g) Einkommensausgleich** Bei dem von der Gesellschaft angewandten Rechnungslegungsstandard handelt es sich um den sog. Einkommensausgleich. Die Einkommensausgleichanpassung stellt sicher, dass an die in ausschüttende Anteile und ausschüttende Anteile II anlegenden Anteilinhaber ausgeschüttetes Einkommen prozentual dem Besitzzeitraum im Ausschüttungszeitraum entspricht. Ein Betrag, der dem Teil des Kurses pro Anteil entspricht, der den etwaigen, bis zum Datum der Ausgabe der Anteile aufgelaufenen, jedoch nicht ausgeschütteten Ertrag wiedergibt, wird als Ausgleichszahlung angesehen und als an den jeweiligen Anteilinhaber zurückbezahlt behandelt, entweder bei (i) Rücknahme dieser Anteile vor der Zahlung der ersten Dividende auf dieselben oder (ii) Zahlung der ersten Dividende, zu der der Anteilinhaber im selben Berichtszeitraum, in dem die Anteile ausgegeben wurden, berechtigt war. Die Zahlung von Dividenden nach der Zahlung der ersten Dividende darauf oder die Rücknahme dieser Anteile nach Zahlung der ersten Dividende wird so ausgelegt, dass darin ein etwaiger, bis zum Datum der jeweiligen Rücknahme oder Erklärung der Dividende aufgelaufener, jedoch unbezahlter Nettoertrag enthalten ist.

### 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT

Zu dieser Kategorie gehören zwei Unterkategorien: zu Handelszwecken gehaltene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten (Handelspositionen), und ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen und -verbindlichkeiten, die die Verwaltung bei Auflegen bestimmt hat. Finanzanlagen und -verbindlichkeiten zu Handelszwecken werden hauptsächlich erworben oder eingegangen, um diese kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen. Derivate fallen ebenfalls in die Kategorie der Handelspositionen, da die Gesellschaft keine Derivate zur Absicherung in einem Absicherungsverhältnis bestimmt. Bei Auflegung ergebniswirksam zum Marktwert ausgewiesene Finanzvermögen und -verbindlichkeiten sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft werden, sondern sie werden verwaltet und ihre Wertentwicklung wird auf Basis des Marktwerts in Übereinstimmung mit der dokumentierten Anlagestrategie des Teilfonds bewertet.

Die Teilfondspolitik erfordert, dass Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd. PIMCO Asia Pte Ltd. und PIMCO Deutschland GmbH („PIMCO" oder „Anlageberatungsgesellschaften") und der Verwaltungsrat die Informationen über diese Finanzvermögen und -verbindlichkeiten auf Basis des Marktwerts gemeinsam mit anderen verbundenen Finanzinformationen bewerten.

Gewinne und Verluste aus Änderungen im Marktwert der Kategorie „ergebniswirksam zum Marktwert bewertete Finanzvermögen" werden in die Betriebsergebnisrechnung in den Zeitraum einbezogen, in dem sie anfallen.

Die Wertpapiere des Teilfonds und anderen Vermögenswerte, für die Marktkurse jederzeit zur Verfügung stehen, werden zum Marktwert bewertet. Der Marktwert wird allgemein auf Grundlage der zuletzt berichteten Verkaufspreise bestimmt, oder wenn keine Verkäufe gemeldet wurden, auf Grundlage der Kurse, die von einem Kursberichtssystem, angestammten Marktmachern oder Kursbestimmungsdiensten stammen.

Anlagen, die zunächst in anderen Währungen als der Funktionswährung des Teilfonds bewertet wurden, werden mithilfe der Wechselkurse von Kursbestimmungsdiensten umgerechnet. Im Ergebnis kann der NIW der Teilfondsanteile von Änderungen des Werts der Währungen gegenüber der Teilfondsfunktionswährung beeinflusst werden. Der Wert von an ausländischen. Märkten gehandelten oder auf andere als die Teilfondsfunktionswährung lautenden Wertpapieren kann an dem Tag deutlich beeinflusst werden, an dem die Irish Stock Exchange („ISE") geschlossen ist, und der NIW kann sich an den Tagen ändern, an denen Anleger keine Anteile erwerben, zurückgeben oder tauschen können.

Hat sich der Wert eines Wertpapieres, das ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt wird, nach dem Schluss der Primärbörse oder des Primärmarkts des Wertpapiers, jedoch vor dem Schluss des Handelstags wesentlich geändert, wird das Wertpapier zum Marktwert auf Grundlage von Verfahren bewertet, die der Verwaltungsrat eingeführt und zugelassen hat. Wertpapiere, die nicht gehandelt werden, wenn ein Teilfonds geöffnet ist, werden ebenfalls zum Marktwert bewertet.

Ein Teilfonds kann den Marktwert von Anlagen auf Grundlage von Informationen bestimmen, die Kursbestimmungsdienste und andere Drittanbieter liefern, die Kurse zum Marktwert oder Anpassungen durch Bezug auf andere Wertpapiere, Indizes oder Vermögenswerte empfehlen können. Wenn ein Teilfonds erwägt, ob Marktbewertung erforderlich ist und bei der Bestimmung der Marktwerte, kann er, unter anderem, wesentliche Ereignisse berücksichtigen (bei denen anzunehmen ist, dass sie Änderungen im Wert von Wertpapieren oder Wertpapierindizes enthalten), die nach dem Schluss des betreffenden Markts und vor dem Schluss des Handelstages eintreten. Ein Teilfonds darf Berechnungswerkzeuge nutzen, die Drittanbieter liefern, um den Marktwert von Wertpapieren zu bestimmen, die von wesentlichen Ereignissen beeinträchtigt wurden. Ausländische Börsen erlauben eventuell den Handel mit ausländischen Wertpapieren an Tagen, an denen die Gesellschaft nicht für das Geschäft geöffnet ist, was dazu führen kann, dass die Portfolioanlagen eines Teilfonds betroffen sind, wenn es nicht möglich ist, Anteile zu kaufen oder zu verkaufen.
Ein Teilfonds hat einen Kursbestimmungsdienst damit beauftragt, den Marktwert ausländischer Wertpapiere zu bestimmen. Dieser Service verwendet Statistiken und Programme, die auf historischer Wertentwicklung von. Märkten beruhen sowie sonstige Wirtschaftsdaten, um ihn beim Schätzen des Marktwerts zu unterstützen. Schätzungen von Marktwerten, die ein Teilfonds für ausländische Wertpapiere nutzt, können vom Wert abweichen, der tatsächlich beim Verkauf dieser Wertpapiere erzielt wird, und die Differenz kann sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Bestimmungen des Marktwerts können subjektive Festsetzungen des Werts eines Wertpapiers oder eines Vermögenswerts erfordern, und der Marktwert, um den NIW eines Teilfonds zu bestimmen, kann von den notierten oder veröffentlichten Kursen oder den Kursen abweichen, die andere für die gleichen Anlagen verwenden. Darüber hinaus führt der Einsatz von Bestimmungen des Verkehrswerts eventuell nicht immer zu Kursanpassungen der Wertpapiere oder anderen Vermögenswerte, die ein Teilfonds hält. Anlagen in Teilfonds der PIMCO Funds, wie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio genauer angegeben, werden zu dem ungeprüften NIW bewertet, der von den zugrunde liegenden Teilfonds ausgewiesenen wird.

FRS 102 Abschnitt 11.27 über „Beizulegender Zeitwert: Offenlegung“ erfordert Angaben bezüglich der Marktbewertungshierarchie, in die die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten eingestuft werden. Die Angaben beruhen auf einer dreistufigen Marktbewertungshierarchie für die in Bewertungsverfahren zur Bemessung des beizulegenden Zeitwerts verwendeten Inputfaktoren. Im März 2016 wurden Änderungen an den Absätzen 34.22 und 34.42 dieses FRS vorgenommen. Hierbei wurden die Angabepflichten für Finanzinstitute und Altersvorsorgepläne überarbeitet. Diese Änderungen sind für Rechnungslegungszeiträume anzuwenden, die am oder nach dem 1. Januar 2017 beginnen. Eine vorzeitige Anwendung ist zulässig. Diese Änderung wurde bei der Erstellung dieses Abschlusses vorzeitig angewandt.

FRS 102 definiert den beizulegenden Zeitwert als den Betrag, zu dem in einem Geschäft zwischen sachverständigen, vertragswilligen und unabhängigen Geschäftspartnern ein Vermögenswert ausgetauscht, eine Verbindlichkeit beglichen oder ein Eigenkapitalinstrument gewährt würde. FRS 102 begründet und verlangt Angaben zur Marktbewertungshierarchie getrennt für jede Hauptklasse von Aktiva und Passiva, die die Bewertung zum Marktwert in Stufen teilt (Stufen 1, 2 und 3). Diese Inputfaktoren oder Verfahren zur Bewertung von Wertpapieren geben nicht unbedingt das Risiko wieder, dass mit der Anlage in diesen Wertpapieren verbunden ist. Die Stufen 1, 2 und 3 der Marktbewertungshierarchie sind wie folgt definiert:

- Stufe 1 — Der nicht bereinigte, an einem aktiven Markt quotierte Preis für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, auf den die Gesellschaft zum Bewertungsstichtag zugreifen kann.
- Stufe 2 — Inputparameter, bei denen es sich nicht um die der Stufe 1 zugeordneten quotierten Preise handelt, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit entweder direkt oder indirekt beobachtbar (z.B. anhand von Marktdaten hergeleitet) sind.
- Stufe 3 — Nicht beobachtbare Inputfaktoren (d. h. für die keine Marktdaten verfügbar sind) für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit.

**Stufe 1 und Stufe 2 Handelsaktiva und -passiva zum Marktwert** Die Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 1 und Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, sieht folgendermaßen aus:

Festverzinsliche Wertpapiere, einschließlich Unternehmens-, Wandel- und Kommunalanleihen sowie Wechsel, Anleihen von US-Regierungsbehörden, US-Schatzobligationen, Staatsemissionen, Bankdarlehen, Wandelvorzugswertpapiere sowie Nicht-US-Anleihen werden gewöhnlich von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändlerangebote, Abschlussmeldungen oder Bewertungsschätzungen ihrer internen Kursbestimmungsmodelle verwenden. Die internen Modelle der Dienstleister nutzen beobachtbare Inputfaktoren, wie Emittenteninformationen, Zinssätze, Renditekurven, Tilgungsgeschwindigkeit, Kreditrisiken/-spreads, Ausfallraten und quotierte Preise für ähnliche Vermögenswerte. Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Rentenwerte, die auf Basis verzögerter Lieferung erworben werden, werden täglich bis zur Abrechnung am Terminabrechnungsdatum bewertet. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere werden bei jedem Handel gewöhnlich als einzelne Tranchen oder Klassen von Wertpapieren herausgegeben. Diese Wertpapiere werden ebenfalls gewöhnlich von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die Wertpapierhändlerangebote oder Bewertungsschätzungen ihrer internen Kursbestimmungsmodelle nutzen. Die Kursbestimmungsmodelle für diese Wertpapiere berücksichtigen gewöhnlich Eigenschaften der Tranchenstufe, aktuelle Marktdaten, geschätzte Kapitalflüsse und marktbasierende Renditespreads für jede Tranche und Börsennebengeschäfte (je nach Verfügbarkeit). Durch Hypotheken und Forderungen besicherte Wertpapiere, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Stammaktien, börsengehandelte Fonds und derivative Finanzinstrumente, wie Futures, Kontrakte oder Optionskontrakte, die an einer nationalen Wertpapierbörse gehandelt werden, werden zum letztberichteten Verkaufs- oder Abrechnungskurs am Bewertungstag angegeben. Wenn diese Wertpapiere aktiv gehandelt werden und keine Bewertungsanpassungen vorgenommen werden, werden sie in Stufe 1 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Bewertungsanpassungen können für bestimmte Wertpapiere durchgeführt werden, die ausschließlich an einer ausländischen Börse gehandelt werden, um die Marktbewegungen zwischen dem Schluss des ausländischen Markts und dem Schluss der lokalen Börse zu berücksichtigen. Diese Wertpapiere werden mithilfe von Kursbestimmungsdiensten bewertet, die den Zusammenhang von Handelsmustern des ausländischen Wertpapieres mit dem Intraday-Handel am lokalen Anlagemarkt berücksichtigen. Wertpapiere, die diese Bewertungsanpassungen nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Vorzugswertpapiere und andere Aktien, die an inaktiven. Märkten gehandelt oder durch Bezug auf ähnliche Instrumente bewertet werden, werden ebenfalls in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Anlagen in eingetragenen offenen Investmentgesellschaften werden auf Grundlage des ungeprüften NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 1 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Anlagen in nicht eingetragenen offenen Anlageverwaltungsgesellschaften werden auf Grundlage des ungeprüften NIW dieser Anlagen bewertet und werden als Stufe 1 betrachtet, vorausgesetzt der NIW ist beobachtbar, wird täglich berechnet und entspricht dem Wert, zu dem sowohl Käufe als auch Verkäufe erfolgen. Anlagen in privaten Investmentfonds werden auf Grundlage des NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Anlagen in privaten Investmentfonds, bei denen die Inputfaktoren der NIW nicht beobachtbar sind, werden auf Grundlage der NIW dieser Anlagen bewertet, und sie werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Kurzfristige Anlagen mit einer Laufzeit von 60 Tagen oder weniger werden allgemein zu amortisierten Kosten bewertet, die dem Marktwert nahekommen. Diese Anlagen werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Freiverkehrsfinanzderivate, wie zum Beispiel Devisenkontrakte, Optionskontrakte oder Swaps beziehen ihren Wert aus den Kursen der zugrunde liegenden Vermögenswerte, Indizes, Referenzsätze und anderen Inputfaktoren oder einer Kombination dieser Faktoren. Diese Kontrakte werden gewöhnlich auf Basis von Wertpapierhändlerangeboten oder Kursbestimmungsdiensten bewertet. Abhängig vom Produkt und den Transaktionsbedingungen kann der Wert eines Derivatkontrakts von einem Kursbestimmungsdienst mithilfe einer Reihe von Techniken, einschließlich simulierter Kursbestimmungsmodelle, bestimmt werden. Diese Kursbestimmungsmodelle nutzen Inputfaktoren aus aktiv handelnden. Märkten, wie zum Beispiel Emittenteninformationen, Indizes, Spreads, Zinssätze, Kurven, Dividenden und Wechselkurse. Derivate, die ähnliche Bewertungstechniken und Inputfaktoren wie zuvor beschrieben nutzen, werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Zentral abgerechnete Swaps, die über eine multilaterale- oder Handelsplattform (z.B. eine registrierte Börse) notiert oder gehandelt werden, werden zum von der betreffenden Börse bestimmten täglichen Abrechnungskurs bewertet. Für zentral abgerechnete Credit Default Swaps verlangt die Clearingstelle von ihren Mitgliedern verfolgbare Stufen während kompletter Laufzeitstrukturen. Diese Stufen werden gemeinsam mit den Preisen außenstehender Dritter zur Ermittlung täglicher Abrechnungskurse verwendet. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet. Zentral abgerechnete Zinsswaps werden mit Hilfe eines Preismodells bewertet, das die zugrunde liegenden Zinssätze, einschließlich der Overnight Index Swap Rate und der LIBOR Forward Rate, berücksichtigt. Diese Wertpapiere werden in Stufe 2 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

**Stufe 3 Handelsaktiva und -passiva zum Marktwert** Die Bewertungstechniken und wesentlichen Inputfaktoren, die verwendet werden, um den Marktwert von Finanzinstrumenten zu bestimmen, die in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet werden, sieht folgendermaßen aus:

Wertpapiere und andere Vermögenswerte, für die Marktkurse nicht jederzeit zur Verfügung stehen, werden zu ihrem Marktwert bewertet, den der Verwaltungsrat oder nach seinem Ermessen handelnde Personen nach gutem Glauben bestimmen und sie werden in Stufe 3 der Marktbewertungshierarchie eingeordnet.

Marktkurse gelten unter den Umständen als nicht jederzeit verfügbar, wenn keine aktuellen oder verlässliche Marktdaten vorliegen (z.B. Handelsinformationen, Angebots-/Nachfrageinformationen), einschließlich von Ereignissen, die nach Schluss des betreffenden Marktes eintreten, jedoch vor Schluss der Irish Stock Exchange (ISE), die den Wert der Teilfondswertpapiere oder -vermögenswerte nachhaltig beeinflussen. Darüber hinaus gelten Marktkurse als nicht jederzeit verfügbar, wenn aufgrund außerordentlicher Umstände die Börsen oder Märkte, an denen die Wertpapiere gehandelt werden, einen ganzen Tag nicht zum Handel geöffnet sind und kein anderer Marktkurs zur Verfügung steht. Der Verwaltungsrat hat PIMCO die Verantwortung übertragen, die wesentlichen Ereignisse, die den Wert der Teilfondswertpapiere oder Vermögenswerte deutlich beeinflussen, zu überwachen sowie zu bestimmen, ob der Wert des betreffenden Wertpapieres oder Vermögenswerts vor dem Hintergrund dieser wesentlichen Ereignisse neu bewertet werden sollte.

Der Verwaltungsrat verwendet Verfahren, um Wertpapiere und andere Vermögenswerte unter den Umständen zu bewerten, unter denen Marktkurse nicht jederzeit zur Verfügung stehen, und hat PIMCO die Verantwortung für das Anwenden dieser Bewertungsmethoden übertragen. In Fällen, in denen keine täglichen Marktkurse zur Verfügung stehen, können Anlagen gemäß den Richtlinien bewertet werden, die der Verwaltungsrat mit Bezug auf andere Wertpapiere oder Indizes eingerichtet hat. Für den Fall, dass das Wertpapier oder der Vermögenswert nicht gemäß einer der Bewertungsmethoden bewertet werden kann, die der Verwaltungsrat eingerichtet hat, bestimmt der Bewertungsausschuss des Verwaltungsrats den Wert des Wertpapieres oder des Vermögenswerts im Allgemeinen auf Grundlage der von PIMCO gelieferten Empfehlungen. Wenn der Teilfonds Marktbewertungsverfahren nutzt, die PIMCO einsetzt, die wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren einsetzen, um den NIW zu bestimmen, werden die Wertpapiere durch ein anderes Verfahren bewertet, bei dem der Verwaltungsrat oder die Personen, die nach seinem Ermessen handeln, annehmen, dass es den angemessenen Marktwert korrekt wiedergibt, und sie werden in Stufe 3 der Bewertungshierarchie eingeordnet. Diese Verfahren können subjektive Festsetzungen des Wertpapierwerts erfordern.

Während die Anlagepolitik eines Teilfonds im Ergebnis die Berechnung des Teilfonds-NIWs vorsieht, der den Wertpapierwert zum Zeitpunkt der Kursbestimmung angemessen wiedergibt, kann der Teilfonds nicht garantieren, dass die vom Verwaltungsrat oder den nach seinen Anweisungen handelnden Personen bestimmten Werte, den Kurs genau wiedergeben würden, den der Teilfonds für ein Wertpapier erzielen könnte, wenn er dieses Wertpapier zum Zeitpunkt der Kursbestimmung veräußern würde (zum Beispiel bei Zwangsverkauf oder Notverkäufen). Die vom Teilfonds verwendeten Kurse können von dem Wert abweichen, der beim Verkauf der Wertpapiere realisiert werden könnte.

**4. BARMITTEL, WERTPAPIERE UND ANDERE ANLAGEN**

**(a) Barmittel und sonstige liquide Vermögenswerte** Barmittel und sonstige liquide Vermögenswerte werden zu ihrem Nennwert, gegebenenfalls mit den aufgelaufenen Zinsen, bewertet. Alle Bankguthaben werden entweder von Brown Brothers Harriman & Co. als täglich fällige Einlagen bei vom Verwaltungsrat zugelassenen Fremdinstituten oder direkt bei einer Unterdepotbank gehalten. Die Tagesgeldeinlagen, die das Anlagen- und Vermögenswertportfolio aufführt, stehen für die tatsächlichen Beträge, die zum Ende des Berichtszeitraums gehalten wurden. Eventuell stimmen diese nicht mit den berichteten Barmittelsalden aus dem Finanzstatus überein. Bestimmte Teilfonds dürfen im Zusammenhang mit ihren Aktivitäten zum Verwalten von Barmitteln auch im PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund anlegen, einem Teilfonds von PIMCO Funds Ireland plc. Die Hauptanlagen des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund erfolgen in Geldmarktinstrumenten und Renteninstrumenten mit kurzer Laufzeit. Dem PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund können Aufwendungen entstehen, die im Zusammenhang mit seinen Anlageaktivitäten stehen. Er zahlt jedoch keine Verwaltungs- oder Beratungsgebühren an PIMCO.

**(b) Transaktionen mit verzögerter Lieferung** Bestimmte Teilfonds dürfen Wertpapiere auf Basis verzögerter Lieferung erwerben oder verkaufen. Ein Teilfonds geht eine Verpflichtung in Bezug auf diese Transaktionen ein, Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Preis oder einer vorab bestimmten Rendite bei Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu erwerben oder zu verkaufen. Sind Geschäfte mit verzögerter Lieferung offen, bestimmt oder erhält der entsprechende Teilfonds in dem Umfang liquide Mittel als Sicherheit, der ausreicht, um den Kaufpreis zu begleichen oder die entsprechenden Verpflichtungen zu erfüllen. Beim Erwerb eines Wertpapiers auf Basis verzögerter Lieferung übernimmt der Teilfonds die Besitzrechte und -risiken des Wertpapiers, einschließlich des Kursrisikos und der Renditeschwankungen, und berücksichtigt diese Schwankungen bei der Bestimmung seines NIW. Ein Teilfonds kann nach Abschluss einer Transaktion auf Basis verzögerter Lieferung diese veräußern oder neu verhandeln, was zu einem Gewinn oder Verlust führen kann. Hat ein Teilfonds ein Wertpapier auf Basis verzögerter Lieferung verkauft, nimmt ein Teilfonds nicht an den zukünftigen Gewinnen und Verlusten dieses Wertpapiers teil.

**(c) Börsengehandelte Fonds** Bestimmte Teilfonds dürfen in börsengehandelte Fonds („ETFs“) anlegen, bei denen es sich im Allgemeinen um indexbasierte Investmentgesellschaften handelt, die im Wesentlichen ihr gesamtes Vermögen in Wertpapieren halten, die in ihrem spezifischen Index geführt werden, die jedoch auch aktiv verwaltete Investmentgesellschaften sein können. Anteile an ETFs werden während des ganzen Tages an einer Börse gehandelt und repräsentieren eine Anlage in einem Portfolio von Wertpapieren und Vermögenswerten. Als Anteilinhaber einer anderen Investmentgesellschaft würde der Teilfonds seinen prozentualen Anteil an den Aufwendungen der anderen Investmentgesellschaften, einschließlich Beratungsgebühren, zusätzlich zu den Aufwendungen tragen, die dem Teilfonds direkt im Zusammenhang mit seiner eigenen Geschäftstätigkeit entstehen.

**(d) Inflationsindexierte Anleihen** Bestimmte Teilfonds dürfen in inflationsindexierte Anleihen anlegen. Inflationsindexierte Anleihen sind festverzinsliche Wertpapiere, deren Kapitalwert regelmäßig an die Inflationsrate angepasst wird. Der Zinssatz für diese Anleihen wird im Allgemeinen bei der Ausgabe niedriger angesetzt als bei normalen Anleihen. Während der Laufzeit einer inflationsindexierten Anleihe werden jedoch Zinsen auf der Basis eines Kapitalwertes gezahlt, der inflationsbereinigt ist. Erhöhungen oder Verringerungen des Kapitalbetrags einer inflationsindexierten Anleihe sind als Zinseinkünfte in der Betriebsergebnisrechnung enthalten, obwohl Anleger ihren Kapitalbetrag nicht vor Fälligkeit erhalten.

**(e) Kreditbeteiligung und -abtretung** Bestimmte Teilfonds können in direkte Schuldinstrumente anlegen, bei denen es sich um Beteiligungen an Beträgen handelt, die Kreditgebern oder Kreditkonsortien von Industrie-, Regierungs- oder sonstigen Darlehensnehmern geschuldet werden. Die Anlagen eines Teilfonds in Darlehen können in Form von Darlehensbeteiligungen oder -abtretungen in sämtliche oder einige Anteile eines Darlehens von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird oft von einer Bank oder einem sonstigen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, der als Vertreter für alle Beteiligten agiert. Der Vertreter verwaltet die Darlehensbedingungen gemäß den Bestimmungen der Darlehensvereinbarung. Ein Teilfonds darf in mehrere Serien oder Tranchen eines Darlehens anlegen, die über unterschiedliche Bedingungen verfügen können und mit denen unterschiedliche Risiken verbunden sind. Im Allgemeinen verfügt ein Teilfonds nicht über das Recht, das Einhalten der Bedingungen einer Darlehensvereinbarung gegenüber dem Kreditnehmer durchzusetzen. Im Ergebnis unterliegt ein Teilfonds eventuell dem Kreditrisiko sowohl des Kreditnehmers als auch des Kreditgebers, der die Darlehensvereinbarung verkauft. Erwirbt ein Teilfonds Abtretungen von Verleihern, erwirbt er direkte Rechte gegenüber dem Darlehensnehmer. Zu diesen Darlehen können Beteiligungen an „Überbrückungskrediten“ gehören. Hierbei handelt es sich um Kredite, die Kreditnehmer für einen kurzen Zeitraum (normalerweise weniger als zwölf Monate) aufnehmen, bis eine auf lange Sicht ausgelegte Finanzierung beispielsweise durch die Ausgabe von Anleihen, häufig High-Yield-Anleihen, die für Akquisitionen emittiert werden, gesichert werden kann. Bestimmte Teilfonds dürfen ebenfalls ungedeckte Darlehenszusagen eingehen. Diese stellen vertragliche Verpflichtungen für zukünftige Finanzierungen dar.

Ungedeckte Darlehenszusagen können revolvierende Kreditfazilitäten enthalten, die die Teilfonds verpflichten können, dem Darlehensnehmer auf Verlangen zusätzliche Barmittel zur Verfügung zu stellen. Ungedeckte Darlehenszusagen sind vollständige zukünftige Verpflichtungen, obwohl ein Prozentsatz der Nominaldarlehensbeträge vom Darlehensnehmer niemals ausgeschöpft wird. Bei Anlagen in Darlehensbeteiligungen verfügt ein Teilfonds über das Recht auf den Erhalt von Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren, auf die er ein Anrecht hat, und zwar ausschließlich gegenüber dem Kreditgeber, der die Darlehensvereinbarung veräußert, und ausschließlich bei Erhalt von Zahlungen des Kreditnehmers an den Kreditgeber. Ein Teilfonds kann für den nicht ausgeschöpften Anteil des zugrunde liegenden Kreditlinienanteils eines variabel verzinslichen Kredits Bereitstellungsgebühren erhalten. Unter bestimmten Umständen kann ein Teilfonds im Fall einer vorzeitigen Tilgung eines variabel verzinslichen Kredits durch einen Kreditnehmer eine Vorfälligkeitsentschädigungsgebühr erhalten. Eingenommene/gezahlte Gebühren werden als Bestandteil der Zinserträge oder Zinsaufwendungen bzw. in der Betriebsergebnisrechnung erfasst.

Zum 31. Dezember 2015 und 31. Dezember 2014 hatte der Teilfonds folgende ungedeckte Darlehenszusagen (Angaben in Tausend):

| Teilfonds | 2015 | 2014 |
|---|---|---|
| Global Investment Grade Credit Fund | - | $ 14.429 |

**(f) Hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere** Bestimmte Teilfonds dürfen in hypothekarisch gedeckte und andere forderungsbesicherte Wertpapiere anlegen, die unmittelbar oder mittelbar die Beteiligung an Hypotheken-darlehen auf Immobilien darstellen oder von diesen besichert und aus diesen zahlbar sind. Hypothekarisch gedeckte Wertpapiere basieren auf Pools von privaten und

gewerblichen Hypothekendarlehen, einschließlich von Spar- und Darlehensinstituten, Hypothekenbanken, Geschäftsbanken und anderen Einrichtungen begebenen Hypothekendarlehen. Diese Wertpapiere leisten monatliche Zahlungen, die sowohl aus Zins- als auch Kapitalzahlungen bestehen. Die Zinsen können durch feste bzw. flexible Zinssätze festgelegt werden. Die Höhe der vorab geleisteten Zahlungen auf zugrunde liegende Hypotheken beeinflusst den Kurs und die Volatilität von hypothekarisch besicherten Wertpapieren und kann, verglichen mit den Antizipationen zum Kaufzeitpunkt, kürzere oder längere effektive Durationen des Wertpapiers zur Folge haben. Die Regierung der USA garantiert, dass Kapital und Zinsen auf bestimmte hypothekarisch besicherte Wertpapiere rechtzeitig gezahlt werden. Von nichtstaatlichen Emittenten zusammengestellte und garantierte Pools, einschließlich staatsnaher Institute, können von unterschiedlich gearteten Versicherungen oder Garantien abgesichert sein. Es kann jedoch nicht zugesichert werden, dass private Versicherer oder Garantiegeber ihre Verpflichtungen aus den Versicherungspolicen bzw. Garantievereinbarungen erfüllen können. Viele dieser Risiken der Anlage in hypothekarisch gedeckte Wertpapiere, die durch gewerbliche Hypothekendarlehen gesichert werden, spiegeln die Folgen der lokalen sowie der sonstigen Wirtschaftslage für die Immobilienmärkte, die Fähigkeit der Mieter, Mietzahlungen zu leisten, sowie die Fähigkeit einer Immobilie wider, Mieter zu interessieren und zu binden. Diese Wertpapiere können weniger liquide sein und eine höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren. Andere forderungsbesicherte Wertpapiere setzen sich aus verschiedenen Vermögensarten, einschließlich Autodarlehen, Kreditkartenforderungen, Hypotheken sowie Studentendarlehen, zusammen.

**(g) Collateralised Mortgage Obligations** Collateralized Mortgage Obligations („CMOs“) sind Schuldtitel eines Rechtssubjekts, die von Whole Mortgage Loans oder privaten Hypothekenanleihen besichert und in Klassen gegliedert sind. CMOs sind in mehrere Klassen gegliedert, die oft als „Tranchen“ bezeichnet werden. Dabei wurde für jede Klasse eine andere Laufzeit festgelegt, und jede Klasse hat das Recht auf einen eigenen Kapital- und Zinszahlungsplan, einschließlich vorfristiger Rückzahlungen. CMOs können weniger liquide sein und höhere Kursvolatilität zeigen als andere Arten von hypothekarisch oder forderungsbesicherten Wertpapieren.

**(h) Stripped Mortgage-Backed Securities** Stripped Mortgage Backed Securities („SMBS“) sind derivative Hypothekenpapiere mit mehreren Klassen. SMBS gliedern sich gewöhnlich in zwei Klassen, die Zins- und Kapitalausschüttungen aus einem Pool von Hypothekenwerten in unterschiedlichen Verhältnissen erhalten. Im Extremfall erhält eine Klasse die gesamten Zinsen (die „IO“ [Interest-Only]-Klasse), während die andere Klasse die gesamten Kapitalzahlungen erhält (die „PO“ [Principal-Only]-Klasse). Für IOs erhaltene Zahlungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Da bei Fälligkeit eines IO kaum oder kein Kapital anfällt, wird der Buchwert des Wertpapieres monatlich bis zur Fälligkeit angepasst. Diese Anpassungen sind in den Zinseinkünften der Betriebsergebnisrechnung enthalten. Für POs erhaltene Zahlungen werden als Herabsetzung der Kosten und der Parität der Wertpapiere behandelt.

**(i) Collateralized Debt Obligations („CDOs“)** enthalten so genannte besicherte Anleiheverbindlichkeiten (Collateralized Bond Obligations, „CBOs“), besicherte Darlehensverbindlichkeiten (Collateralized Loan Obligations, „CLOs“) sowie andere ähnlich strukturierte Wertpapiere. CBOs und CLOs sind Arten forderungsbesicherter Wertpapiere. Bei einem CBO handelt es sich um einen Fonds, der von einem diversifizierten Pool hoch riskanter Rentenpapiere mit einem Rating unterhalb von Investment Grade besichert ist. Ein CLO ist ein Fonds, der typischerweise von einem Darlehenspool besichert ist, der unter anderem in- und ausländische, vorrangige, besicherte Darlehen, vorrangige, nicht besicherte Darlehen und nachrangige Unternehmensdarlehen, einschließlich Darlehen mit einem Rating unter Investment Grade oder äquivalente unbewertete Darlehen enthalten. Die Risiken aus einer Anlage in einem CDO hängen größtenteils von der Art der als Sicherheit dienenden Wertpapiere und der Klasse des CDO ab, in die ein Teilfonds anlegt. CBOs, CLOs und andere CDOs sind mit zusätzlichen Risiken verbunden, einschließlich insbesondere, (i) dass Ausschüttungen aus als Sicherheit dienenden Wertpapieren möglicherweise nicht ausreichen, um Zinsen oder sonstige Auszahlungen zu begleichen, (ii) die Qualität der Sicherheit im Wert nachgeben oder in Verzug geraten kann, (iii) dass der Teilfonds in CBOs, CLOs und andere CDOs anlegen kann, die anderen Klassen untergeordnet sind, und (iv) dass die komplexe Struktur des Wertpapiers zum Zeitpunkt der Anlage nicht vollständig verstanden wird und Konflikte mit dem Emittenten hervorrufen oder unerwartete Anlageergebnisse herbeiführen kann.

**(j) Wertpapiere mit Sachausschüttungen** Bestimmte Teilfonds dürfen in Wertpapiere mit Sachausschüttungen (Payment In-Kind Securities, „PIKs“) anlegen. PIKs gewähren dem Emittenten ggf. die Möglichkeit, zu jedem Zinszahlungsdatum Zinszahlungen entweder bar oder in zusätzlichen Schuldpapieren vorzunehmen. Diese zusätzlichen Schuldpapiere verfügen gewöhnlich über die gleichen Bedingungen wie die Originalanleihen, einschließlich Fälligkeitsdaten und Zinssätzen sowie verbundenen Risiken. Die täglichen Kursnotierungen der Originalanleihen können angefallene Zinsen enthalten („Dirty Price“ [Kurs einschließlich Stückzinsen]). Diese sind als Bestandteil des zum Marktwert bewerteten Finanzvermögens aus übertragbaren Wertpapieren im Finanzstatus enthalten.

**(k) Pensionsgeschäfte** Bestimmte Teilfonds dürfen Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem typischen Pensionsgeschäft nimmt der Teilfonds einen Basisschuldtitel (Sicherheit) vorbehaltlich der Verpflichtung des Verkäufers zum Rückkauf und des Teilfonds zum Weiterverkauf der Verbindlichkeit zu einem vereinbarten Preis und Zeitpunkt in Besitz. Der Marktwert der Sicherheit muss jederzeit dem Gesamtbetrag der Rückkaufverbindlichkeiten einschließlich Zinsen entsprechen oder höher sein als dieser Gesamtbetrag. Pensionsgeschäfte, einschließlich angefallene Zinsen, sind im Finanzstatus enthalten. Zinseinkünfte werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinserträge erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten muss ein Teilfonds eventuell eine Gebühr für den Erhalt von Sicherheiten bezahlen, was zu Zinsaufwendungen für den Teilfonds führen kann.

**(l) Beschränkt handelbare Wertpapiere** Bestimmte Teilfonds dürfen in Wertpapiere anlegen, die rechtlichen oder vertraglichen Weiterverkaufseinschränkungen unterliegen. Diese Wertpapiere dürfen privat verkauft werden, müssen aber vor dem Verkauf an die Öffentlichkeit eingetragen oder von einer solchen Eintragung befreit werden. Privat platzierte Wertpapiere gelten allgemein als beschränkt handelbar, mit Ausnahme der Wertpapiere, die qualifizierte institutionelle Investoren gemäß den Bestimmungen von Rule 144A des Securities Act von 1933 untereinander handeln. Der Verkauf von eingeschränkten Wertpapieren kann zeitaufwändige Verhandlungen sowie Aufwendungen beinhalten und der sofortige Verkauf zu einem akzeptablen Kurs kann schwierig zu erzielen sein. Zum 31. Dezember 2015 umlaufende beschränkt handelbare Wertpapiere werden in den Anlagen- und Vermögenswertportfolios offengelegt.

**(m) Umgekehrte Pensionsgeschäfte** Bestimmte Teilfonds dürfen umgekehrte Pensionsgeschäfte eingehen. Bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft übergibt ein Teilfonds einem Finanzinstitut, dem Kontrahenten, ein Wertpapier im Gegenzug für Barmittel, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im Wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und Datum. Der Teilfonds ist zum Erhalt etwaiger Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung geliefert wurde, vorgenommen wurden. Barmittel, die für gelieferte Wertpapiere ausbezahlt wurden, zuzüglich aufgelaufener Zinszahlungen, die von einem Teilfonds an Kontrahenten vorzunehmen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Vom Teilfonds an Kontrahenten vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Teilfonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Teilfonds führen kann. Ein Teilfonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus einem umgekehrten Pensionsgeschäft zu erfüllen.

**(n) Leerverkäufe** Bestimmte Teilfonds dürfen Leerverkaufs-Transaktionen tätigen. Ein Leerverkauf ist eine Transaktion, bei der ein Teilfonds Wertpapiere, die nicht in seinem Besitz sind, im Vorgriff auf einen Rückgang der Marktpreise der Wertpapiere verkaufen kann. In einem umgekehrten Pensionsgeschäft etwaige veräußerte Wertpapiere und auf diese zahlbare Zinsen werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit wiedergegeben. Ein Teilfonds ist verpflichtet, die Wertpapiere zum Zeitpunkt der Glattstellung der Short Position zum Handelspreis zu liefern. Während die etwaigen Verluste aus einem Leerverkauf unbegrenzt sein können, können die Verluste aus den Käufen die Höhe des angelegten Gesamtbetrages nicht übersteigen.

**(o) US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderte Unternehmen** Bestimmte Teilfonds dürfen in Wertpapiere von US-Regierungsbehörden oder staatlich geförderten Unternehmen anlegen. Wertpapiere von US-Regierungsbehörden sind Obligationen der US-Regierung, ihrer Behörden oder Organe und sind in bestimmten Fällen von diesen verbrieft. Einige Wertpapiere der US-Regierung, wie zum Beispiel Schatztitel, Wechsel und Anleihen, sowie von der Government National Mortgage Association („GNMA“ oder „Ginnie Mae“) verbriefte Wertpapiere, werden von der US-Regierung in vollem Umfang unterstützt; andere, wie zum Beispiel von Federal Home Loan Banks, sichert das Recht, dass der Emittent vom US Department of the Treasury (das „US Finanzministerium“) leihen darf, und andere, wie zum Beispiel von der Federal National Mortgage Association („FNMA“ oder „Fannie Mae“) werden dadurch gesichert, dass die US-Regierung nach eigenem Ermessen Obligationen der Behörde erwerben kann. Wertpapiere der US-Regierung können Nullkuponwertpapiere enthalten, wie US-Schatz-Kupons. Das sind festverzinste Wertpapiere, die mit einem Abschlag auf den Nennwert verkauft werden und für die keine Zinszahlungen anfallen. Anleger erhalten bei Fälligkeit vielmehr den Nennwert ausgezahlt. Nullkuponwertpapiere schütten keine laufenden Zinsen aus. Für sie gelten höhere Risiken als für zinszahlende Wertpapiere.

Zu den regierungsnahen Garantiegebern (d. h. ohne Schutz der vollumfänglichen Unterstützung der Regierung der USA) zählen die FNMA und die Federal Home Loan Mortgage Corporation („FHLMC“ oder „Freddie Mac“). Die FNMA ist eine staatlich geförderte Gesellschaft. Die FNMA erwirbt konventionelle (d. h. nicht von einer Regierungsbehörde versicherte oder verbriefte) Immobilienhypotheken aus einem Verzeichnis zugelassener Verkäufer/Dienstleister. Zu diesen zählen staatlich und

bundesstaatlich amtlich zugelassene Spar- und Darlehenskassen, Genossenschaftsbanken, Geschäftsbanken, Kreditgenossenschaften und Hypothekenbanken. Für von der FNMA begebene Durchlaufpapiere garantiert die FNMA die rechtzeitige Zahlung von Kapital und Zinsen. Sie genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der Regierung der USA. Die FHLMC gibt Participation Certificates („PCs“) aus. Bei ihnen handelt es sich um Durchlaufpapiere. Jedes vertritt die ungeteilte Beteiligung an einem Pool von Wohnhypotheken. Die FHLMC garantiert die rechtzeitige Zahlung von Zinsen und den endgültigen Kapitaleinzug. PCs genießen jedoch nicht die vollumfängliche Unterstützung der US-Regierung.

**(p) Transaktionen mit Emissionstermin** Bestimmte Teilfonds dürfen Wertpapiere auf Basis „per Emissionstermin“ erwerben oder verkaufen. Diese Transaktionen erfolgen bedingt, da ein Wertpapier, obwohl genehmigt, sich noch nicht auf dem Markt befindet. Diese Transaktionen beinhalten eine Verpflichtung seitens des Teilfonds, diese Wertpapiere zu einem vorab bestimmten Kurs oder einer vorab bestimmten Rendite mit Zahlung und Lieferung außerhalb des üblichen Abrechnungszeitraums zu kaufen oder zu verkaufen. Ein Teilfonds darf Wertpapiere auf Basis „per Emission“ verkaufen, bevor diese ausgehändigt werden, was zu einem realisierten Kapitalgewinn oder -verlust führen kann.

**(q) Sale-Buybacks** Bestimmte Teilfonds können Finanzierungsgeschäfte eingehen, die als ‚Sale-Buybacks‘ (Verkäufe-Rückkäufe) bezeichnet werden. Ein Sale-Buyback-Geschäft (Rückkauf-Finanzierung) besteht aus dem Verkauf eines Wertpapiers durch einen Teilfonds an ein Finanzinstitut, den Kontrahenten, mit einer gleichzeitigen Vereinbarung zum Rückkauf desselben oder im wesentlichen desselben Wertpapiers zu einem vereinbarten Preis und an einem vereinbarten Datum. Ein Teilfonds ist nicht zum Erhalt von Kapital- und Zinszahlungen berechtigt, die auf das Wertpapier, das an den Kontrahenten während der Laufzeit der Vereinbarung verkauft wurde, vorgenommen wurden. Die vereinbarten Erlöse für Wertpapiere, die von einem Teilfonds zurückzukaufen sind, werden im Finanzstatus als Verbindlichkeit ausgewiesen. Ein Fonds weist Nettoerträge aufgrund eines Preisunterschieds zwischen dem für das übertragene Wertpapier erhaltenen Preis und dem vereinbarten Rückkaufpreis aus. Dies wird allgemein als Preisrückgang bezeichnet. Ein Preisrückgang besteht aus (i) den entfallenen etwaigen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen, die ein Teilfonds ansonsten erhalten hätte, wenn das Wertpapier nicht verkauft worden wäre, und (ii) den zwischen einem Teilfonds und dem Kontrahenten vereinbarten Finanzierungsbedingungen. Die etwaigen entfallenen Zins- und inflationären Ertragsberichtigungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteile des Zinsertrags ausgewiesen. Von einem Teilfonds an Kontrahenten aufgrund von ausgehandelten Finanzierungsbedingungen vorgenommene Zinszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als Bestandteil der Zinsaufwendungen erfasst. In Zeiträumen mit erhöhtem Bedarf an Sicherheiten kann ein Teilfonds eventuell eine Gebühr für den Einsatz des Wertpapiers durch den Kontrahenten erhalten, was zu Zinseinkünften für den Teilfonds führen kann. Ein Teilfonds stellt von den Anlageberatungsgesellschaften oder anderweitig für liquide erklärte Vermögenswerte zurück, die dazu bestimmt sind, die Verpflichtung aus Sale-Buyback-Geschäften zu erfüllen.

**5. FINANZDERIVATE**

Die folgenden Offenlegungen enthalten Informationen darüber, wie und warum die Teilfonds Finanzderivate einsetzen, über mit dem Kreditrisiko verbundene bedingte Eigenschaften bestimmter Finanzderivate und wie Finanzderivate die finanzielle Lage, das Ergebnis der Geschäftstätigkeit und die Kapitalflüsse der Teilfonds beeinflussen. Die zum Ende eines Berichtszeitraums ausstehenden Finanzderivate, wie sie im Anlagen- und Vermögenswertportfolio erfasst werden, und die Beträge der realisierten und die Veränderungen der nicht realisierten Gewinne und Verluste aus Finanzderivaten während des Berichtszeitraums, wie sie in der Betriebsergebnisrechnung erfasst werden, dienen als Indikatoren für den Umfang der Finanzderivataktivitäten für die Teilfonds.

**(a) Aktiengebundene Wertpapiere** Bestimmte Teilfonds dürfen aktiengebundene Wertpapiere erwerben. Diese sind auch als Beteiligungsscheine, Aktienswaps sowie Zero-Strike-Calls und Optionsscheine bekannt. Ein Teilfonds nutzt aktiengebundene Wertpapiere hauptsächlich als Alternative, um effizienter und effektiver Zugang zu so genannten Schwellen-Wertpapiermärkten zu erhalten. Ein Teilfonds hinterlegt im Tausch gegen ein aktiengebundenes Wertpapier Barmittel bei seiner Depotbank (oder seinem Wertpapierhändler, wenn dies rechtlich zulässig ist), deren Betrag dem Verkaufskurs des Basiswertpapiers nahe ist oder diesem entspricht. Bei Verkauf erhält ein Teilfonds Barmittel von seinem Wertpapierhändler oder seiner Depotbank, die dem Wert des Basiswertpapiers entsprechen. Neben dem Marktrisiko der Basiswertpapiere besteht das Risiko der Säumnis des Kontrahenten der Transaktion. Bei Insolvenz des Kontrahenten könnte ein Teilfonds nicht in der Lage sein, den erwarteten Nutzen zu erlangen. Ein Teilfonds ist bestrebt, solche Transaktionen nur mit Parteien einzugehen, die in der Lage sind, tatsächlich solche Abschlüsse mit dem Teilfonds zu tätigen. Es gibt allerdings keine Garantie dafür, dass der Teilfonds bis zum Ende der Laufzeit der Basisvereinbarung jederzeit in der Lage ist, eine solche Transaktion mit dem Kontrahenten abzuschließen oder eine glattstellende Position mit einem Kontrahenten zu erlangen. Das kann die Fähigkeit eines Teilfonds beeinträchtigen, andere Transaktionen zu einem dafür günstigen Zeitpunkt einzugehen.

**(b) Devisenterminkontrakte** Bestimmte Teilfonds dürfen Devisenterminkontrakte in Verbindung mit der Abrechnung geplanter Käufe oder Verkäufe von Wertpapieren eingehen, um Währungsrisiken in Verbindung mit einigen oder allen Teilfonds-wertpapieren abzusichern oder als Teil der Anlagestrategie. Ein Devisenterminkontrakt ist ein Vertrag zwischen zwei Parteien über den Kauf und Verkauf einer Währung zu einem bestimmten Kurs zu einem zukünftigen Zeitpunkt. Der Marktwert eines Devisenterminkontrakts schwankt mit den Änderungen der Wechselkurse. Devisenterminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und die Wertänderung wird vom Teilfonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Realisierte Gewinne oder Verluste, die dem Unterschied zwischen dem Wert des Kontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schließung entsprechen, werden mit Lieferung oder Erhalt der Währung erfasst. Diese Kontrakte können mit Marktrisiken verbunden sein, die über den nicht realisierten Gewinn oder Verlust hinausgehen, die im Finanzstatus wiedergegeben werden. Zusätzlich kann ein Teilfonds Risiken ausgesetzt sein, wenn die Kontrahenten nicht in der Lage sind, die Vertragsbedingungen zu erfüllen, oder wenn sich der Wert der Währung gegenüber der Funktionswährung nachteilig ändert. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Barmittel oder Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Sicherungsgeschäften im Finanzstatus ausgewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind nicht in der Bewertung zum Marktwert in den Erläuterungen zum Anlagen- und Vermögenswertportfolio enthalten, sondern gelten als Stufe 2-Beteiligung. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

**(c) Terminkontrakte** Bestimmte Teilfonds dürfen Terminkontrakte abschließen. Ein Teilfonds kann Terminkontrakte verwenden, um sein Risiko an den Wertpapier-märkten oder gegenüber Schwankungen der Zinssätze und Währungskurse zu verwalten. Die Hauptrisiken in Verbindung mit dem Einsatz von Terminkontrakten sind die unvollständige Korrelation zwischen der Veränderung des Marktwertes der von einem Teilfonds gehaltenen Wertpapiere und den Preisen von Terminkontrakten sowie die Möglichkeit eines illiquiden Marktes. Terminkontrakte werden auf der Basis ihrer täglich festgestellten Abrechnungskurse bewertet. Beim Abschluss eines Terminkontrakts muss ein Teilfonds bei seinem Terminhändlereinen Geldbetrag oder US-Regierungs- und Behördenanleihen sowie ausgewählte Staatsanleihen in Übereinstimmung mit den ursprünglichen erforderlichen Einschüssen des Händlers oder der Börse hinterlegen. Terminkontrakte werden täglich zum letzten Börsenkurs bewertet, und der Teilfonds erfasst die entsprechende Forderung oder Verbindlichkeit für die Wertänderung („Variation Margin“). Gewinne oder Verluste werden erfasst, gelten jedoch nicht als realisiert, bis die Kontrakte auslaufen oder glattgestellt werden. Terminkontrakte beinhalten in unterschiedlichem Maße Verlustrisiken, die über den Bewertungsgewinn hinausgehen, der im betreffenden Finanzstatus dargestellt ist.

**(d) Optionskontrakte** Bestimmte Teilfonds dürfen Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente verkaufen, die sich in ihrem Besitz befinden oder in die sie anlegen dürfen. Der Verkauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Teilfonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu erhöhen. Der Verkauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Risiko für einen Teilfonds aus dem zugrunde liegenden Instrument zu senken. Veräußert ein Teilfonds eine Kauf- oder Verkaufsoption, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Diese Verbindlichkeiten sind im Finanzstatus enthalten. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Gewinne erfasst. Erhaltene Prämien aus dem Verkauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den Erlösen hinzuzurechnen oder gegen die aus den zugrunde liegenden Futures, Swaps, Wertpapiere oder Währungs-transaktionen gezahlten Beträge aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust zu bestimmen. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien erworben werden, die zu einem späteren Zeitpunkt festgelegt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf implizierten Volatilitätsparametern zu bestimmten Bedingungen. Ein Teilfonds, der eine Option veräußert, hat keine Kontrolle darüber, ob das Basisinstrument verkauft (Call) oder gekauft (Put) wird, und im Ergebnis trägt er das Marktrisiko einer ungünstigen Kursänderung des Instruments, das der Verkaufsoption zugrunde liegt. Es besteht das Risiko, dass sich der Teilfonds aufgrund eines illiquiden Marktes eventuell nicht in der Lage sieht, die Transaktion glattzustellen.

Bestimmte Teilfonds dürfen ebenfalls Verkaufs- und Kaufoptionen erwerben. Der Kauf von Verkaufsoptionen neigt dazu, das Teilfondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu erhöhen. Der Kauf von Kaufoptionen neigt dazu, das Teilfondsrisiko gegenüber den zugrunde liegenden Instrumenten zu senken.

Ein Teilfonds zahlt eine Prämie, die ergebniswirksam zum Marktwert als Finanzvermögen in den Finanzstatus einfließt, und später neu bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Gezahlte Prämien für den Kauf von Optionen, die auslaufen, werden als realisierte Verluste verbucht. Bestimmte Optionen dürfen mit Prämien gekauft werden, die zu einem zukünftigen Datum bestimmt werden. Die Prämien für diese Optionen basieren auf implizierten Volatilitätsparametern zu bestimmten Bedingungen. Das mit dem Kauf von Verkaufs- und Kaufoptionen verbundene Risiko beschränkt sich auf die gezahlte Prämie. Gezahlte Prämien aus dem Kauf von Optionen, die ausgeübt oder glattgestellt werden, sind den gezahlten Beträgen hinzuzufügen oder gegen die Erlöse aus dem Basisanlagegeschäft aufzurechnen, um den realisierten Gewinn oder Verlust bei Ausführung der zugrunde liegenden Transaktion zu bestimmen.

**Inflation-Capped Options** Bestimmte Teilfonds können Inflation-Capped Options kaufen oder verkaufen, um die Renditen zum Zwecke von Absicherungsmöglichkeiten zu erhöhen. Veräußert ein Teilfonds eine Inflation-Capped Option, dann erfasst er einen Betrag, der der erhaltenen Prämie entspricht, als Verbindlichkeit und bewertet diese zum letzten Börsenkurs, um den aktuellen Wert der verkauften Option wiederzugeben. Kauft ein Teilfonds eine Inflation-Capped Option, bezahlt der Teilfonds eine Prämie, die als Vermögenswert ausgewiesen und dann zum letzten Börsenkurs bewertet wird, um den aktuellen Wert der Option wiederzugeben. Der Kauf von Inflation-Capped Options soll einen Teilfonds vor Inflationserosion über einem bestimmten Satz aus einer bestimmten angenommenen Beteiligung schützen. Zum Schutz von Anlagen in inflationsgekoppelten Produkten kann eine Untergrenze (Floor) verwendet werden.

**Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte** Bestimmte Teilfonds können Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte („Futures Option") kaufen oder verkaufen, um eine vorhandene Position oder künftige Investments abzusichern, zu Spekulationszwecken oder zur Verwaltung des Risikos im Zusammenhang mit Marktschwankungen. Eine Futures Option ist ein Optionskontrakt, dessen Basiswert ein einziger Futures-Kontrakt ist.

**Optionen auf Rohstoffterminkontrakte** Bestimmte Teilfonds können Optionen auf Rohstoffterminkontrakte („Rohstoffoptionen") verkaufen oder kaufen. Der Basiswert für die Rohstoffoption ist nicht der Rohstoff selbst, sondern vielmehr ein Terminkontrakt auf den Rohstoff. Zur Ausübung einer Rohstoffoption gehört nicht die tatsächliche Lieferung des zugrunde liegenden Rohstoffs, sondern vielmehr die Zahlung des Differenzbetrags zwischen dem aktuellen Marktwert des zugrunde liegenden Futures Contract und dem Ausübungskurs direkt auf das Depotkonto eines Teilfonds. Bei Optionen, die „im Geld" sind, wird ein Teilfonds normalerweise die Position ausgleichen, anstatt die Option auszuüben, um den Restzeitwert zu wahren.

**Credit Default Swaptions** Bestimmte Teilfonds können Credit Default Swaptions kaufen oder verkaufen, um eine Absicherung des Kreditrisikos einer Anlage zu erreichen, ohne sich dem Basiswert gegenüber zu verpflichten. Eine Credit Default Swaption ist eine Option zum Verkauf oder Kauf von Kreditschutz für einen bestimmten Referenzwert durch Abschluss eines vordefinierten Swaps zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt.

**Zins-Swaptions** Bestimmte Teilfonds können Zins-Swaptions eingehen, wobei es sich um Optionen zum Abschluss vordefinierter Swap-Vereinbarungen zu einem bestimmten zukünftigen Zeitpunkt handelt. Der Verkäufer der Swaption wird bei Ausübung durch die Käufer zum Kontrahenten des Swaps. Aus der Zinsswaption geht hervor, ob der Käufer der Swaption bei Ausübung ein Empfänger eines festen Zinssatzes ist oder einen festen Zinssatz bezahlt.

**Devisenoptionen** Bestimmte Teilfonds können Devisenoptionen verkaufen oder kaufen. Durch den Kauf von Devisenoptionen erhält ein Teilfonds das Recht, ist jedoch nicht verpflichtet, die Währung zu kaufen oder zu verkaufen, und es ist der Betrag der Währung und der Wechselkurs angegeben, zu dem die Ausübung zu einem bestimmten Datum durchgeführt werden kann. Diese Optionen können als Kauf- oder Verkaufsdeckungsgeschäft gegen mögliche Schwankungen der Wechselkurse oder zum Aufbau eines Engagements in Devisen dienen.

**Optionen auf Wertpapiere** Bestimmte Teilfonds können Optionen auf Wertpapiere eingehen. Eine Option verwendet ein bestimmtes Wertpapier als Basiswert für den Optionskontrakt. Ein Teilfonds kann Optionen verkaufen oder kaufen, um Renditen zu erhöhen oder um eine vorhandene Position oder zukünftige Anlage abzusichern.

**Straddle-Optionen** Bestimmte Teilfonds können verschiedene Formen von Straddle-Optionen verwenden. Bei einem Straddle handelt es sich um eine Anlagestrategie, die Kombinationen aus Optionen einsetzt, die es dem Teilfonds ermöglichen, auf der Basis zukünftiger Preisschwankungen (nach oben oder unten) des zugrunde liegenden Wertpapiers zu profitieren. Ein verkaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Verkauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der verkaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts vor dem Verfallsdatum nur geringfügig schwankt. Ein gekaufter Straddle umfasst den gleichzeitigen Kauf einer Kaufoption und einer Verkaufsoption auf dasselbe Wertpapier zum selben Ausübungskurs und mit demselben Verfallsdatum. Der gekaufte Straddle erhöht sich im Wert, wenn der Preis des Basiswerts ungeachtet der Richtung vor dem Verfalldatum stark schwankt.

**(e) Swaps** Bestimmte Teilfonds dürfen in Swaps anlegen. Swaps sind bilateral verhandelte Vereinbarungen zwischen einem Teilfonds und einem Kontrahenten, um Anlagekapitalflüsse, Vermögenswerte, Devisen oder marktgebundene Erträge zu bestimmten, zukünftigen Intervallen zu wechseln oder zu tauschen. Swaps werden privat im Freiverkehr (OTC-Swaps) verhandelt und können auf einer multilateralen- oder anderen Handelsplattform, z.B. an einer registrierten Börse („zentral abgerechnete Swaps") ausgeübt werden. Ein Teilfonds darf Asset-Swaps, Credit Default Swaps, Cross Currency Swaps, Zinsswaps, Total Return Swaps, Variance Swaps sowie andere Arten von Swaps eingehen, um sein Kredit-, Währungs-, Zins-, Rohstoff-, Aktien- und Inflationsrisiko zu verwalten. In Verbindung mit diesen Vereinbarungen können Wertpapiere oder Barmittel in Übereinstimmung mit den Bedingungen des jeweiligen Swaps zu Sicherheiten oder Hinterlegungssummen bestimmt werden, um bei Säumnis oder Konkurs/Insolvenz auf werthaltige Vermögenswerte zurückgreifen zu können.

Swaps werden täglich auf der Grundlage der Werte von Drittanbietern, die eingetragene Börsen sein können, oder Preisangaben von Primärhändlern im verfügbaren Umfang mit dem letzten Börsenkurs bewertet. Sollten keine Marktbewertungen verfügbar sein, und kann der Swap nicht gemäß einer der Bewertungsmethoden bewertet werden, wird der Wert des Swaps in gutem Glauben vom Bewertungsausschuss der Anlageberatungsgesellschaft bestimmt. Wertänderungen, falls vorhanden, werden in der Betriebsergebnisrechnung als Nettoänderung der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) erfasst. Tägliche Änderungen bei der Bewertung zentral abgerechneter Swaps, falls vorhanden, werden im Finanzstatus als Forderung oder Verbindlichkeit aus Wertänderungen („Variation Margin") ausgewiesen. Zu Beginn des Berichtszeitraums geleistete oder erhaltene Zahlungen aus OTC Swaps werden als solche im Finanzstatus ausgewiesen und repräsentieren Prämien, die bei Abschluss des Swaps als Ausgleich für Differenzen zwischen den vereinbarten Bedingungen des Swaps und der vorherrschenden Marktbedingungen (Kreditspreads, Wechselkurse, Zinssätze und andere relevante Faktoren) gezahlt oder vereinnahmt wurden. Diese Abschlussprämien werden bei Beendigung oder Fälligkeit des Swaps in der Betriebsergebnisrechnung als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Bei Beendigung eines Swaps erhaltene oder geleistete Liquidierungszahlungen werden in der Betriebsergebnisrechnung als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Vom Teilfonds regelmäßige erhaltene oder geleistete Nettozahlungen werden als Teil der realisierten Gewinne oder Verluste in die Betriebsergebnisrechnung einbezogen.

Der Abschluss dieser Vereinbarungen umfasst in unterschiedlichem Ausmaß Elemente von Zins-, Kredit-, Markt- und Dokumentationsrisiken enthalten, die über den im Finanzstatus enthaltenen Umfang hinausgehen. Diese Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass kein liquider Markt für diese Vereinbarungen existiert, dass der Kontrahent dieser Vereinbarungen seinen Pflichten nicht nachkommt oder die Vertragsbedingungen anders auslegt und dass ungünstige Zinsentwicklungen auftreten können.

Das maximale Verlustrisiko eines Teilfonds aus dem Kontrahentenkreditrisiko entspricht dem diskontierten Nettowert der während der Vertragsrestlaufzeit vom Kontrahenten zu erhaltenden Kapitalflüsse, falls dieser Betrag positiv ist. Das Risiko wird von einer Rahmenaufrechnungsvereinbarung zwischen einem Teilfonds und dem Kontrahenten abgeschwächt, sowie durch die Stellung von Sicherheiten für einen Teilfonds, um das Kontrahentenrisiko eines Teilfonds abzudecken.

**Korrelationsswaps** Bestimmte Teilfonds dürfen in Korrelationsswaps anlegen, um Engagements in die Basisreferenzwerte einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Bei Korrelationsswaps vereinbaren zwei Parteien den Tausch von Kapitalflüssen auf Basis der gemessenen Korrelation bestimmter Basisreferenzwerte. Eine Partei stimmt zu, eine „feste Zinszahlung" oder eine Zahlung zum Ausübungskurs für den „variablen Zinssatz" oder die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts gegenüber dem Nennbetrag zu tauschen. Bei Auflegung wird der Ausübungskurs allgemein so gewählt, dass der Marktwert des Swaps bei Null liegt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kurskorrelation des Basisvermögenswerts und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Teilfonds den Auszahlungsbetrag

erhalten, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Als Zahler der Kurskorrelation mit fester Zinszahlung würde der Teilfonds den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts unter dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die Korrelation über dem Ausübungskurs liegt. Diese Art von Vereinbarung ist im Grunde ein Terminkontrakt auf die zukünftig realisierte Kurskorrelation des Basisvermögenswerts.

**Credit Default Swaps** Bei Credit Default Swaps nimmt eine Partei (der Sicherungsnehmer bezeichnet) eine Reihe von Zahlungen an eine andere Partei (der Sicherungsgeber) gegen das Recht vor, im Verzugsfall oder bei einem anderem Kreditereignis der Referenzeinheit, des referenzierten Index oder der referenzierten Obligation, einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Als Sicherungsgebern in Credit Default Swaps erhält der Teilfonds gewöhnlich vom Sicherungsnehmer einen festen Einkommenssatz während der Laufzeit des Swaps, vorausgesetzt, es tritt kein Kreditereignis ein. Als Verkäufer würde ein Teilfonds seinem Portfolio effektiv Fremdfinanzierung hinzufügen, da zusätzlich zu seinen Gesamtnettovermögenswerten der Teilfonds dem Anlagerisiko auf den Nennbetrag des Swaps unterliegen würde.

Tritt der Teilfonds als Sicherungsgeber auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag bis zum Nominalwert des Swaps und übernimmt, in bestimmten Fällen, das Liefern der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, entspricht. Tritt der Teilfonds als Sicherungsnehmer auf und tritt ein Kreditereignis ein, das in den Bedingungen dieses bestimmten Swaps festgelegt ist, erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nominalwert des Swaps entspricht, und übernimmt die Lieferung der referenzierten Verbindlichkeit, einer anderen zu liefernden Obligation oder des Basiswertpapiers, das im referenzierten Index enthalten ist, oder (ii) erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln oder Wertpapieren, der dem Nominalbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der referenzierten Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im dem referenzierten Index enthalten ist. Die Restwerte werden von Primärhändlern geschätzt, indem sie entweder branchenübliche Restwerte oder für die Einheit typische Größen und Erwägungen berücksichtigen, bis ein Kreditereignis eintritt. Sobald ein Kreditereignis eingetreten ist, werden die Restwerte mittels einer gestützten Auktion bestimmt, wobei eine Mindestanzahl zulässiger Maklergebote gemeinsam mit einer vorgeschriebenen Bewertungsmethode zur Bestimmung des Abwicklungswerts benutzt werden.

Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen oder Staats- oder US-Kommunalanleihen beinhalten einen Zahlungsfluss durch die eine an die andere Partei im Gegenzug für das Recht, einen bestimmten Ertrag im Verzugsfall oder eines anderen. Tritt ein Kreditereignis ein und es wird nicht zugunsten eines Barmittelausgleichs entschieden, kann eine Vielzahl anderer lieferbarer Obligationen anstelle der bestimmten referenzierten Obligation geliefert werden. In der Lage zu sein, andere Obligationen zu liefern, kann zu einer CTD-Option (das Recht des Sicherungsnehmers, die zu liefernde Obligation mit dem geringsten Wert nach einem Kreditereignis zu liefern) führen. Der Teilfonds darf Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen, Staatsanleihen oder US-Kommunalanleihen zur Absicherung gegen den Zahlungsausfall von Emittenten einsetzen (d. h. um das Risiko zu senken, wenn der Teilfonds Beteiligungen an der Referenzobligation besitzt oder ihrem Risiko ausgesetzt ist) oder um eine aktive Long oder Short Position in Bezug auf die Wahrscheinlichkeit des Verzugs eines bestimmten Emittenten einzugehen.

Credit Default Swaps auf MBS-Körbe [hypothekenbesicherte Wertpapiere] beinhalten, dass eine Partei einen Zahlungsfluss an eine andere Partei im Gegenzug für das Recht vornimmt, im Fall einer Wertberichtigung, von Mindereinnahmen für Kapital oder Zinsen oder Zahlungsunfähigkeit aller oder eines Teils der Referenz-MBS-Wertpapiere einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Der Korb besteht aus verschiedenen MBS mit potenziell unterschiedlichen Attributen des Basiswerts, wie u. a. Emittent, Kreditrating und Zinssatz. Diese Swaps beziehen sich auf alle Namen im Korb, und bei Zahlungsverzug wird das Kreditereignis auf Basis der Gewichtung des entsprechenden Namens im Korb beglichen. Jedes Wertpapier könnte im Korb ein unterschiedliches Gewicht haben. Vorfälligkeitszahlungen, Kapitalrückzahlungen und andere Abschreibungs- oder Verlustereignisse auf ein MBS senken den ausstehenden Nennbetrag des Korbs entsprechend dem Gewicht dieses Wertpapiers im Korb. Diese Reduzierungen können, wie in den Bedingungen der Swap-Vereinbarung definiert, vorübergehend oder dauerhaft sein. Der Teilfonds darf Credit Default Swaps auf MBS-Körbe verwenden, um zur Absicherung gegen einen Verzug der Basis-MBS oder um eine aktive Long- oder Short-Position wegen des möglichen Verzugs von Basis-MBS aufzubauen.

Credit Default Swaps auf forderungsbesicherte Wertpapiere enthalten einen Zahlungsfluss durch die eine an die andere Partei gegen das Recht, im Verzugsfall oder im Fall eines anderen Kreditereignisses einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Anders als Credit Default Swaps auf Unternehmensanleihen, Darlehen, Staats- oder US-Kommunalanleihen wären lieferbare Obligationen in den meisten Fällen auf die bestimmte referenzierte Obligation begrenzt, da die Wertentwicklung von forderungsbesicherten Wertpapieren von Handel zu Handel schwanken kann. Vorauszahlungen, Kapitalanzahlungen und andere Abschreibungs- oder Verlustereignisse auf die Basishypothekendarlehen senken den ausstehenden Kapitalbetrag der referenzierten Obligation. Diese Abnahme kann, wie in den Bedingungen der Swaps definiert, zeitweise oder dauerhaft sein, und der Nennbetrag für den Swap wird um die entsprechenden Beträge angepasst. Der Teilfonds darf Credit Default Swaps auf forderungsbesicherte Wertpapiere verwenden, um zur Absicherung gegen einen Verzug der referenzierten Obligation oder um eine aktive Long oder Short Position wegen des möglichen Verzugs einer bestimmten referenzierten Obligation aufzubauen.

Credit Default Swaps auf Kreditindizes beinhalten, dass eine Partei einen Zahlungsfluss an einer andere Partei im Gegenzug für das Recht vornimmt, im Fall einer Wertberichtigung, von Mindereinnahmen für Kapital oder Zinsen oder Zahlungsunfähigkeit aller oder eines Teils der Referenzeinheiten, aus denen der Kreditindex besteht, einen bestimmten Ertrag zu erhalten. Bei einem Kreditindex handelt es sich um einen Korb von Kreditinstrumenten- oder Engagements, die einen Teil des Kreditmarkts als Ganzes verkörpern. Diese Indizes bestehen aus Referenzkrediten, die mittels Umfrage von Händlern von diesen als die liquidesten Titel unter den Credit Default Swaps basierend auf dem Bereich des Index bestimmt werden. Indexkomponenten können insbesondere Wertpapiere mit Investment Grade-Rating, hoch rentierliche Wertpapiere, forderungsbesicherte Wertpapiere, Schwellenmärkte und/oder unterschiedliche Kredit-Ratings innerhalb des jeweiligen Bereichs enthalten. Kreditindizes werden mithilfe von Credit Default Swaps zu standardisierten Bedingungen einschließlich eines festen Spreads und Standardfälligkeiten gehandelt. Ein Index Credit Default Swap bezieht sich auf alle Namen im Index, und bei Zahlungsverzug wird das Kreditereignis auf Basis der Gewichtung des entsprechenden Namens im Index beglichen. Die Zusammensetzung der Indizes ändert sich regelmäßig, gewöhnlich alle sechs Monate, und bei den meisten Indizes verfügt jeder Name über die gleiche Gewichtung im Index. Der Teilfonds darf Credit Default Swaps auf Kreditindizes einsetzen, um ein Portfolio von Credit Default Swaps oder -anleihen abzusichern, der nicht so teuer ist wie der Kauf zahlreicher Credit Default Swaps, um einen ähnlichen Effekt zu erreichen. Credit Default Swaps auf Indizes sind Instrumente, die Anleger, die Anleihen besitzen, gegen Zahlungsausfall schützen sollen. Sie werden von Wertpapierhändlern genutzt, um auf Änderungen der Kreditqualität zu spekulieren.

Auf absoluter Grundlage dargestellte, implizite Kreditspreads, die zum Ende des Geschäftsjahres zur Bestimmung des Marktwerts von Credit Default Swaps für Unternehmensanleihen, Darlehen, Staats- oder US-Kommunalanleihen verwendet werden, werden in den Anlagen- und Vermögenswertportfolios ausgewiesen. Sie dienen als Indikator für den gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos und stellen die Wahrscheinlichkeit oder das Risiko eines Ausfalls für das Kreditderivat dar. Der implizite Kreditspread einer bestimmten Referenzeinheit reflektiert die Kosten von Schutzkäufen/-verkäufen und kann Vorauszahlungen beinhalten, die zum Abschluss der Vereinbarung geleistet werden müssen. Größere Kreditspreads repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert. Bei Credit Default Swaps für forderungsbesicherte Wertpapiere und Kreditindizes dienen die notierten Marktpreise und die sich daraus ergebenden Werte als Indikator des gegenwärtigen Status des Zahlungs-/Performancerisikos. Eine Erhöhung der Marktwerte auf absoluter Basis im Vergleich mit dem nominellen Betrag des Swaps repräsentieren einen Rückgang der Bonität der Referenzeinheit und eine größere Wahrscheinlichkeit oder ein größeres Risiko für einen Ausfall oder den Eintritt eines anderen Kreditereignisses, wie in den Vereinbarungsbedingungen definiert.

Der maximal mögliche Betrag (nicht abgezinst), den ein Teilfonds als Sicherungsgeber zukünftig unter einem Credit Default Swap eventuell zahlen muss, entspricht dem Nennbetrag der Vereinbarung. Die Nennbeträge eines jeden zum 31. Dezember 2015 ausstehenden Credit Default Swaps des Teilfonds als Sicherungsgeber werden in den Anlagen- und Vermögenswertportfolios ausgewiesen. Diese potenziellen Beträge würden teilweise von vorhandenen Restwerten der jeweiligen referenzierten Obligationen, von beim Abschluss der Vereinbarung erhaltenen Vorauszahlungen oder von bei der Abwicklung von Credit Default Swaps (mit dem Teilfonds in der Position des Sicherungsnehmers), erhaltenen Nettobeträgen ausgeglichen, die der Teilfonds für die gleiche(n) Referenzeinheit(en) eingeht.

**Währungsswaps** Bestimmte Teilfonds können Währungsswap-Vereinbarungen eingehen, um Devisenengagements einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Währungsswap-Vereinbarungen beinhalten zwei Parteien, die zwei unterschiedliche Währungen mit einer Vereinbarung tauschen, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu festgelegten Tauschsätzen umzukehren. Der Tausch von Währungen zum Auflegungsdatum des Kontrakts findet zum aktuellen Kassakurs statt. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum selben Wechselkurs, zu einem bestimmten Kurs oder zu dem zu diesem Zeitpunkt aktuellen Kassakurs erfolgen. Ggf. zu leistende Zinszahlungen erfolgen zwischen den Parteien auf Basis von Zinssätzen, die in den beiden Währungen zum Auflagedatum des Kontrakts zur Verfügung stehen. Die Laufzeiten für Währungsswaps können sich über viele Berichtszeiträume erstrecken. Währungsswaps werden gewöhnlich mit Geschäfts- und Anlagebanken verhandelt. Einzelne Währungsswaps sehen eventuell keinen Tausch von Kapitalbarmittelflüssen vor, sondern ausschließlich den Tausch von Zinsbarmittelflüssen.

Bei Absicherungen von Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den betreffenden Anteilsklassen zugeordnet. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Sicherungsgeschäften im Finanzstatus ausgewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste sind nicht in der Bewertung zum Marktwert in den Erläuterungen zum Anlagen- und Vermögenswertportfolio enthalten, sondern gelten als Stufe 2-Beteiligung. Im Zusammenhang mit diesen Verträgen können Wertpapiere in Übereinstimmung mit den Bedingungen der jeweiligen Verträge zu Sicherheiten bestimmt werden.

**Zinsswaps** Bestimmte Teilfonds unterliegen bei der Realisierung ihres Anlageziels einem Zinsrisiko. Da ein Teilfonds festverzinsliche Anleihen hält, kann der Wert dieser Anleihen sinken, wenn die Zinssätze steigen. Um die Absicherung gegen dieses Risiko zu unterstützen und seine Fähigkeit aufrecht zu erhalten, Einkünfte zu marktüblichen Zinssätzen zu erzielen, darf der Teilfonds Zinsswaps eingehen. Bei Zinsswaps tauscht der Teilfonds mit einer anderen Partei deren jeweilige Zinszahlungsverpflichtungen auf den Kapitalnennbetrag. Bestimmte Arten von Zinsswaps können Folgendes beinhalten: (i) Zinssatz-Obergrenzen, bei denen eine Partei zustimmt, gegen eine Prämie in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze einen bestimmten Satz oder eine bestimmte „Obergrenze“ überschreiten, (ii) Zinssatzuntergrenzen, bei denen eine Partei gegen eine Prämie zustimmt, in dem Fall Zahlungen an die andere vorzunehmen, dass die Zinssätze unter einen bestimmten Satz oder „Untergrenze“ fallen, (iii) Zinssatz-Ober- und -Untergrenzen, bei denen eine Partei eine Obergrenze veräußert und eine Untergrenze erwirbt oder umgekehrt, um sich selbst gegen Zinssatzbewegungen zu schützen, die bestimmte Mindest- oder Höchstsätze überschreiten, (iv) abrufbare Zinsswaps, bei denen der Käufer für das Recht, die Swaptransaktion als Ganzes zu Nullkosten zu einem bestimmten Datum und zu einem Zeitpunkt vor dem Fälligkeitsdatum beenden zu dürfen, eine im Voraus zahlbare Gebühr bezahlt, (v) Spreadsperren, die es dem Zinsswapverwender erlauben, das Termindifferential (oder den Spread) zwischen dem Zinsswapsatz und einem bestimmten Benchmark festzuschreiben, oder (vi) Basisswaps, bei denen zwei Parteien variable Zinssätze tauschen, die auf unterschiedlichen Segmenten der Geldmärkte basieren.

**Recovery Locks** Bestimmte Teilfonds können Vereinbarungen zur Festlegung des Rückerlangungsbetrags (Recovery Locks) eingehen. Recovery Locks werden verwendet, um den Rückerlagungsbetrag einer Referenzobligation zu dem Zeitpunkt, zu dem die Parteien die Vereinbarung eingehen, festzulegen. Im Gegensatz zu anderen Arten von Derivaten müssen die Parteien bei Recovery Locks im Allgemeinen keine im Voraus zu leistenden oder regelmäßigen Barzahlungen machen. Statt dessen werden Zahlung und Abrechnung nach Eintritt eines Kreditereignisses durchgeführt. Tritt vor dem Ablaufdatum eines Recovery Lock kein Kreditereignis ein, endet die Vereinbarung und die Parteien nehmen keine Zahlungen vor. Der Teilfonds kann ein Recovery Lock eingehen, um eine Referenzobligation bei Eintritt eines Kreditereignisses zu kaufen oder zu verkaufen.

Ist der Teilfonds Käufer eines Recovery Lock und ein Kreditereignis tritt ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Vereinbarung definiert, wird der Teilfonds entweder (i) einen Betrag bezahlen, der dem Nennwert entspricht, multipliziert mit dem Ausübungssatz, und er erhält die Referenzobligation, oder (ii) eine Nettoabrechnung erhalten (bezahlen), die dem Nennwert entspricht, multipliziert mit dem Rückerlangungssatz abzüglich dem Ausübungssatz. Ist der Teilfonds Verkäufer eines Recovery Lock und ein Kreditereignis tritt ein, wie in den Bedingungen der betreffenden Vereinbarung definiert, wird der Teilfonds entweder (i) einen Betrag erhalten, der dem Nennwert entspricht, multipliziert mit dem Ausübungssatz, und er erhält die Referenzobligation, oder (ii) eine Nettoabrechnung erhalten (bezahlen), die dem Nennwert entspricht, multipliziert mit dem Ausübungssatz, abzüglich dem Rückerlangungssatz. Der Rückerlangungssatz wird mittels einer gestützten Auktion bestimmt, wobei eine Mindestanzahl zulässiger Maklergebote gemeinsam mit einer vorgeschriebenen Bewertungsmethode zur Bestimmung des Werts der referenzierten Obligation benutzt werden.

**Total Return Swaps** Bestimmte Teilfonds dürfen Total Return Swaps eingehen. Total Return Swaps auf Rohstoffe enthalten Verpflichtungen, bei denen Barmittel auf Basis von Rohstoffkursen gegen entweder feste oder variable Kurse oder Zinssätze getauscht werden. Eine Partei würde in diesem Fall Zahlungen auf Basis des Marktwerts des beteiligten Rohstoffs erhalten und einen festen Betrag zahlen. Total Return Swaps auf Indizes enthalten Verpflichtungen zur Zahlung von Zinsen im Tausch gegen einen marktgebundenen Ertrag. Ein Kontrahent zahlt den Gesamtertrag eines bestimmten Referenzvermögenswerts aus. Dabei kann es sich um eine Aktie, einen Index oder eine Anleihe handeln. Im Gegenzug erhält er regelmäßige Zahlungsflüsse. In dem Umfang, in dem der Gesamtertrag eines Basiswertpapiers oder -index die Abwicklungszinsverpflichtung übertrifft oder unterschreitet, erhält der Teilfonds eine Zahlung vom Kontrahenten bzw. leistet eine Zahlung an den Kontrahenten.

Bestimmte Teilfonds dürfen in Total Return Equity Swaps („Aktienswaps“) anlegen. Aktienswaps können eingesetzt werden, um einen Gewinn abzusichern oder um einen Verlust zu vermeiden, der aus Schwankungen im Wert oder Kurs von Aktien oder Finanzinstrumenten oder einem Index aus diesen Aktien oder Finanzinstrumenten herrührt. Bei einem Aktienswap handelt es sich um ein derivatives Instrument, das die wirtschaftliche Wertentwicklung und den Kapitalfluss einer traditionellen Aktienanlage nachbilden soll.

Das Aktienswaps eigene Risiko hängt von der Position eines Teilfonds bei einer Transaktion ab: wenn ein Teilfonds Aktien-Swaps einsetzt, kann er sich in eine Long Position zum Basiswert bringen. In diesem Fall profitiert der Teilfonds von allen Wertzunahmen der Basisaktie und erleidet jede Wertabnahme. Die einer Long Position eigenen Risiken gleichen den mit dem Kauf der Basisaktie einhergehenden Risiken. Umgekehrt kann sich der Teilfonds in eine Short Position zum Wert der Basisaktie bringen. In diesem Fall profitiert der Teilfonds von allen Kursverfällen der Basisaktie und erleidet Verluste aus etwaigen Kurszunahmen. Die mit einer Short Position einhergehenden Risiken sind größer als die einer Long Position: Während es bei einer Long Position einen maximalen Höchstverlust gibt, wenn die Basisaktie mit null bewertet wird, entspricht der maximale Verlust aus einer Short Position der Wertzunahme der Basisaktie. Diese Zunahme ist theoretisch unbegrenzt.

Allerdings ist anzumerken, dass die Short bzw. Long Position eines Aktienswaps auf dem Urteil der Anlageberatungsgesellschaften über die zukünftige Richtung des Basiswertpapiers beruht. Die Position könnte sich nachteilig auf die Wertentwicklung des Teilfonds auswirken.

**Variance Swaps** Bestimmte Teilfonds dürfen in Variance Swaps anlegen, um Engagements in die Basisreferenzwerte einzugehen oder die damit verbundenen Risiken zu reduzieren. Bei Variance Swaps vereinbaren zwei Parteien den Tausch von Kapitalflüssen auf Basis der gemessenen Varianz (oder der quadrierten Volatilität) eines bestimmten Basisvermögenswerts. Eine Partei stimmt zu, eine „feste Zinszahlung“ oder eine Zahlung zum Ausübungskurs gegen die Varianz im „variablen Zinssatz“ oder im realisierten Kurs des Basisvermögenswerts gegenüber dem Nennbetrag zu tauschen. Bei Auflegung wird der Ausübungskurs allgemein so gewählt, dass der Marktwert des Swaps bei Null liegt. Zum Fälligkeitsdatum wird ein Nettokapitalfluss getauscht, wobei der Auszahlungsbetrag der Differenz zwischen der realisierten Kursvarianz des Basisvermögenswerts und dem Ausübungskurs multipliziert mit dem Nennbetrag entspricht. Als Empfänger der realisierten Kursvarianz würde der Teilfonds den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die realisierte Kursvarianz des Basisvermögenswerts über dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die Varianz unter dem Ausübungskurs liegt. Als Kostenträger der realisierten Kursvarianz würde der Teilfonds den Auszahlungsbetrag schulden, wenn die realisierte Kursvarianz des Basisvermögenswerts über dem Ausübungskurs liegt und würde den Auszahlungsbetrag erhalten, wenn die Varianz unter dem Ausübungskurs liegt. Diese Art von Vereinbarung ist im Grunde ein Terminkontrakt auf die zukünftig realisierte Kursvarianz des Basisvermögenswerts.

## 6. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Teilfonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Teilfonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Teilfonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategien einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2015 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug USD 2.726.513/(USD 652.890) (31. Dezember 2014 USD 1.878.504/(USD 26.446)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2015 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug USD 4.433.388/(USD 10.921.724) (31. Dezember 2014 USD 2.535.882/(USD 2.398.582)).

Der durch die Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2015 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) insgesamt betrug USD 43.751.465/(USD 4.707.471) (31. Dezember 2014 USD 33.079.822/(USD 3.569.939)).

## 7. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und herrschender Praxis qualifiziert sich die Gesellschaft als Investmentgesellschaft gemäß Definition in § 739B des Taxes Consolidation Act von 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung. Auf dieser Basis ist sie für ihre Erträge und Kapitalgewinne in Irland nicht steuerpflichtig. Bei Eintritt eines „steuerpflichtigen Ereignisses" kann jedoch in Irland eine Steuer anfallen. Ein steuerpflichtiges Ereignis schließt alle Ausschüttungszahlungen an Anteilinhaber und alle Einlösungen, Rücknahmen, Stornierungen oder Übertragungen von Anteilen sowie den Anteilsbesitz zum Ende eines jeden Achtjahreszeitraums vom Kauf dieser Anteile ein.

Die Gesellschaft unterliegt in Irland keiner Steuer bei steuerpflichtigen Ereignissen mit Bezug auf:

(a) Anteilinhaber, die im steuerlichen Sinne zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses nicht in Irland ansässig oder gewöhnlich ansässig sind, vorausgesetzt, dass der Gesellschaft die erforderlichen, unterzeichneten Erklärungen gemäß den Bestimmungen des Taxes Consolidation Act, 1997 in seiner jeweils geltenden Fassung vorliegen, werden vom Teilfonds gehalten oder der Teilfonds wurde von Irish Revenue bevollmächtigt, mangels entsprechender Erklärungen Brutto-Zahlungen vorzunehmen, und

(b) bestimmte steuerbefreite, in Irland ansässige Anleger, die der Gesellschaft die erforderlichen, unterzeichneten gesetzlichen Erklärungen vorgelegt haben.

Vorbehaltlich der Einhaltung der „entsprechenden Maßnahmen" sieht der Finance Act von 2010 vor, dass die Finanzkommissare es Investmentfonds, die außerhalb Irlands vertrieben werden, genehmigen dürfen, Zahlungen an nicht in Irland wohnhafte Anleger vorzunehmen, ohne irische Steuern einzubehalten, wenn keine entsprechende Erklärung vorliegt. Ein Teilfonds, der zugelassen werden möchte, muss dies schriftlich bei den Finanzkommissaren beantragen und die Einhaltung der betreffenden Bedingungen bestätigen.

Die aus den Anlagen der Gesellschaft vereinnahmten Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne (falls vorhanden) können in dem Land, in dem sie vereinnahmt werden, einer Quellensteuer unterliegen. Diese Steuer kann von der Gesellschaft oder ihren Anteilinhabern unter Umständen nicht wiedererlangt werden.

In Übereinstimmung mit dem von der britischen Steuerbehörde United Kingdom HM Revenue and Customs eingeführten, neuen Regelwerk für Reporting Funds wird jede einzelne Anteilsklasse zu Zwecken der Besteuerung in Großbritannien als eigenständiger „Offshore-Fonds" betrachtet. Das Regelwerk für Reporting Funds lässt zu, dass ein Offshore-Fonds beim HM Revenue and Customs vorab um Zulassung für die Behandlung als Reporting Fund ersuchen kann. Sobald ein Offshore-Fonds den Status eines „Reporting Fund" erhalten hat, behält er diesen Status, so lange er die Bedingungen für einen „Reporting Fund" erfüllt, ohne dass er dafür die erneute Zulassung bei der HM Revenue und Customs beantragen muss. Jede Anteilsklasse der Gesellschaft wird als „Berichtsfonds" behandelt. Dies wurde von HM Revenue and Customs genehmigt.

## 8. DIVIDENDENAUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Teilfondsergänzung angegeben, können Dividendenausschüttungen festgesetzt werden auf:

(i) Nettokapitalerträge, die aus Zinsen und Dividenden abzüglich Aufwendungen bestehen.
(ii) Realisierte Gewinne aus der Veräußerung von Anlagen abzüglich realisierter und nicht realisierter Verluste (einschließlich Gebühren und Aufwendungen). Für den Fall, dass die bei der Veräußerung von Anlagen realisierten Gewinne abzüglich der realisierten und nicht realisierten Verluste negativ sind, können die Teilfonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
(iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Teilfonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Teilfonds ausgeschüttet werden können.
(iv) Nettokapitalerträge und/oder Kapital.
(v) Bruttoerträge, wobei die Verwaltungsgebühr und andere Gebühren oder ein Teil davon dem Kapital belastet wird. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anleger ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteile der Income II Class (wodurch höhere Renditen für Anteilinhaber erzielt werden sollen) kann der Verwaltungsrat in seinem Ermessen entscheiden, die Gebühren aus dem Kapital zu bezahlen und das Renditedifferenzial zwischen den jeweiligen abgesicherten Anteilsklassen und den grundlegenden Anteilsklassen in Erwägung zu ziehen (was einer Ausschüttung aus dem Kapital entspricht). Das Renditedifferenzial kann positiv oder negativ sein und wird aufgrund der Differenz zwischen der impliziten Rendite der Währung der jeweiligen abgesicherten Anteilsklasse und der Basiswährung des Teilfonds errechnet.

Im Falle der Teilfonds Emerging Asia Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund und US Short-Term Fund sowie der Anteile der Class M Retail werden Dividendenausschüttungen monatlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers monatlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Für die Anteilsklassen G Retail, G Institutional und Investor Income A werden Dividenden jährlich festgesetzt und je nach Wahl des Anteilinhabers jährlich in bar ausgezahlt oder in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Im Falle aller anderen Teilfonds und Anteilsklassen werden Ausschüttungen vierteljährlich festgesetzt und werden, abhängig von der Entscheidung des Anteilinhabers, in bar ausgezahlt oder nach der Erklärung in zusätzliche Anteile reinvestiert.

Dividendenausschüttungen an Inhaber rückgabeberechtigter Anteile werden in der Betriebsergebnisrechnung als Finanzierungskosten klassifiziert. Die auf die thesaurierenden Anteile entfallenden Erträge oder Kapitalzuwachs werden weder festgesetzt noch ausgeschüttet. Statt dessen wird der NIW je Anteil der thesaurierenden Anteile entsprechend dieser Erträge oder dieses Wertzuwachses erhöht. Dividendenausschüttungen, die nicht in Anteile reinvestiert werden, werden den Anteilinhabern per Banküberweisung ausgezahlt. Dividendenausschüttungen, die nach Ablauf von sechs Jahren ab dem Datum ihrer Erklärung nicht eingefordert werden, verfallen und fließen an den jeweiligen Teilfonds zurück. Die Anteilinhaber können sich entscheiden, die Dividendenausschüttungen in zusätzliche Anteile zu reinvestieren oder sich die Dividendenausschüttungen bar auszahlen zu lassen, indem sie das entsprechende Kästchen im Antragsformular auswählen.

Für die nachfolgenden Teilfonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

| Teilfonds | 2015 | 2014 |
|---|---|---|
| Emerging Asia Bond Fund | $ 995 | $ 773 |
| Euro Income Bond Fund | € 879 | - |
| Income Fund | $ 1.192 | - |

## 9. SOFT COMMISSIONS

Der Teilfonds bzw. seine Anlageberatungsgesellschaften können Transaktionen über Dritt-Broker abschließen. Der Teilfonds bzw. seine Anlageberatungsgesellschaften können diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen wie z.B. Research-Leistungen verwendet werden können.

## 10. GETRENNTE HAFTUNG

Zusätzlich zu den relevanten Bestimmungen des Investment Funds, Companies and Miscellaneous Provisons Act, 2005 hat die Gesellschaft die getrennte Haftung der Teilfonds eingeführt. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Teilfonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Teilfonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Teilfonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

## 11. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSURKUNDE UND DER SATZUNG

Eine auf den 30. September 2015 datierte überarbeitete Gründungsurkunde und Satzung wurde herausgegeben und am 1. Oktober 2015 von der Zentralbank zur Kenntnis genommen. Der Verkaufsprospekt wurde am 14. Oktober 2015 konsolidiert. Folgende Sachverhalte wurden in den Ergänzungen zum konsolidierten Verkaufsprospekt geändert:

- Änderungen am PIMCO Asia Local Bond Fund (30. April 2015)
- Änderungen am Commodity Real Return Fund (zuvor: CommoditiesPLUS™ Strategy Fund) (31. März 2015)

- Änderungen am Diversified Income Fund (10. November 2015)
- Änderungen am Diversified Income Duration Hedged Fund (19. Februar 2015)
- Änderungen am Emerging Markets Corporate Bond Fund (23. Januar 2015)
- Änderungen am Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (zuvor: Emerging Markets Currency Fund) (30. September 2015)
- Änderungen am Euro Credit Fund (29. Mai 2015)
- Änderungen am Euro Real Return Fund (6. Mai 2015)
- Änderungen am Global Bond Fund (23. Februar 2015)
- Änderungen am Global High Yield Bond Fund (29. Mai 2015)
- Änderungen am Global Investment Grade Credit Fund (23. Februar 2015 und 18. März 2015)
- Änderungen am Global Low Duration Real Return Fund (29. Mai 2015)
- Änderungen am Global Multi-Asset Fund (30. Juni 2015)
- Änderungen am Global Real Return Fund (29. Mai 2015)
- Änderungen am Income Fund (8. Dezember 2015)
- Änderungen am Low Average Duration Fund (29. Mai 2015)
- Auflegung des Teilfonds PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (11. Juni 2015)
- Auflegung des Teilfonds PIMCO RAE Fundamental Europe Fund (11. Juni 2015)
- Auflegung des Teilfonds PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (11. Juni 2015)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (zuvor: EM Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund) (30. Juni 2015 und 30. November 2015)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (zuvor: Global Fundamental Index®StocksPLUS™ Fund) (30. Juni 2015 und 30. November 2015)
- Änderungen am PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (zuvor: US Fundamental Index® StocksPLUS™ Fund) (30. Juni 2015 und 30. November 2015)
- Auflegung des Teilfonds PIMCO RAE Fundamental US Fund (11. Juni 2015)
- Änderungen am Total Return Bond Fund (29. Mai 2015)
- Auflegung des und Änderungen am PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (8. Juni 2015 und 17. Juli 015)
- Änderungen am US High Yield Bond Fund (zuvor: High Yield Bond Fund) (31. März 2015)
- Auflegung des US Small Cap StocksPLUS™ Fund (4. Februar 2015)

## 12. GEBÜHREN UND KOSTEN

### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlenden Gebühren werden nachfolgend aufgeführt und dürfen 2,50 % per annum des NIWs des jeweiligen Teilfonds nicht übersteigen.

### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert Anlageberatungs-, Administrations-, Depot- und sonstige Dienste, für die jeder Teilfonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr für jeden Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Depot- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Teilfonds erbracht hat. Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Teilfonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

| Teilfonds | Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin Classes, Class S (%) | Class H Inst'l (%) | Class E, G Retail, M Retail, T (%) | Class R (in %) |
|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia Local Bond Fund | 0,85 | 1,02 | 1,55 | 0,85 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | 0,93 |
| Commodity Real Return Fund | 0,74 | 0,91 | 1,64 | 0,90 |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | 0,90 | 1,07 | 1,80 | 0,99 |
| Diversified Income Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | 0,87 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | 0,87 |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund[1] | 0,83 | 1,00 | 2,19 | 1,20 |
| Emerging Asia Bond Fund | 0,65 | 0,82 | 1,50 | 0,83 |
| Emerging Local Bond Fund | 0,89 | 1,06 | 1,89 | 1,04 |
| Emerging Markets 2018 Fund | 0,50 | 0,67 | 1,30 | 0,72 |
| Emerging Markets Bond Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | 0,93 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 1,15 | 1,32 | 2,05 | 1,13 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 0,85 | 1,02 | 1,75 | 0,96 |
| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | 1,35 | 1,52 | 2,50 | 1,38 |
| PIMCO EqS Emerging Markets Fund[2] | 1,25 | 1,42 | 2,45 | 1,35 |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™[1] | 0,89 | 1,06 | 2,09 | 1,15 |
| PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™[1] | 0,89 | 1,06 | 2,09 | 1,15 |
| Euro Bond Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Euro Credit Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Euro Income Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Euro Long Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Euro Low Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Euro Real Return Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Euro Short-Term Fund | 0,40 | 0,57 | 1,15 | 0,63 |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Global Advantage Fund | 0,70 | 0,87 | 1,70 | 0,94 |
| Global Advantage Real Return Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | 0,87 |
| Global Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Global Bond Ex-US Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| PIMCO Global Dividend Fund[1] | 0,83 | 1,00 | 2,19 | 1,20 |
| Global High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Global Multi-Asset Fund | 0,95 | 1,12 | 2,15 | 1,18 |
| Global Real Return Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Income Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| Inflation Strategy Fund | 0,90 | 1,07 | 2,10 | 1,16 |
| Low Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund[3] | 0,83 | 1,00 | 2,04 | 1,05 |
| PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund[4] | 0,75 | 0,92 | 1,60 | 0,88 |
| PIMCO RAE Fundamental Europe Fund[5] | 0,45 | 0,62 | 1,30 | 0,72 |
| PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund[6] | 0,50 | 0,67 | 1,35 | 0,74 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 1,15 | 1,32 | 2,50 | 1,38 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | 0,95 | 1,12 | 2,25 | 1,24 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | 0,85 | 1,02 | 2,15 | 1,18 |
| PIMCO RAE Fundamental US Fund[5] | 0,40 | 0,57 | 1,25 | 0,69 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 0,89 | 1,06 | 1,74 | 0,96 |
| StocksPLUS™ Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| Strategic Income Fund[7] | 0,85 | 1,02 | 1,75 | 0,94 |
| Total Return Bond Fund | 0,50 | 0,67 | 1,40 | 0,77 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund[8] | 1,15 | 1,32 | 2,25 | 1,22 |
| UK Corporate Bond Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |

| Teilfonds | Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin Classes, Class S (%) | Class H Inst'l (%) | Class E, G Retail, M Retail, T (%) | Class R (in %) |
|---|---|---|---|---|
| UK Low Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| UK Real Return Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Unconstrained Bond Fund | 0,90 | 1,07 | 1,80 | 0,99 |
| US High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| US Short-Term Fund[(9)] | 0,45 | 0,62 | 0,85 | 0,47 |
| US Small Cap StocksPLUS℠ Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |

(1) Für alle Klassen außer Class R wird bei der Zahl der Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,16 % p.a. berücksichtigt, der sich ab der Auflegung bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren. In den Gebühren für Class R wird der Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,09 % p.a. berücksichtigt, der sich ab der Auflegung bis zu dem Zeitpunkt verlängert, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

(2) In den Gebühren für Class Institutional, Investor und Administrative wird der Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,20 % p.a. berücksichtigt. In den Gebühren für Class E, G Retail und M Retail wird der Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,05 % p.a. berücksichtigt. In den Gebühren für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,03 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

(3) Bei allen Klassen wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,16 % p.a. berücksichtigt, der von der Auflegung bis zum 30. November 2016 gilt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Dezember 2016 ab.

(4) Für alle Klassen bis auf die Class R berücksichtigt diese Zahl einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,20 %. Für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,11 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zum 30. Juni 2016. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2016.

(5) Für alle Klassen bis auf die Class R berücksichtigt diese Zahl einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 %. Für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,05 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zum 30. Juni 2016. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2016.

(6) Für alle Klassen bis auf die Class R berücksichtigt diese Zahl einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 %. Für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,06 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zum 30. Juni 2016. Der Gebührenverzicht endet am 1. Juli 2016.

(7) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 % vom 1. Dezember 2014 bis zum 30. November 2015. Vom 1. Dezember 2015 bis 30. November 2016 wird der Gebührenverzicht des Managers 0,05 % betragen. Der Gebührenverzicht endet am 1. Dezember 2016.

(8) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,25 % bis zum 30. November 2016. Der Gebührenverzicht endet am 1. Dezember 2016.

(9) In den Gebühren für die Klassen E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt. Für Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,16 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diese Gebühr aufzuheben oder künftig nicht mehr anzuwenden.

Während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2015 nahmen der Strategic Income Fund Institutional und die Anteilsklassen G Institutional, Investor, Administrative Classes und Class S Änderungen von 0,80 % auf 0,85 %, Class H Institutional von 0,97 % auf 1,02 %, Classes E, G Retail und M Retail von 1,70 % auf 1,75 % und Class R von 0,89 % auf 0,94 % vor. Die Managementgebühr für alle anderen Teilfonds blieb gegenüber 2014 unverändert.

Der PIMCO Asia Local Bond Fund, der PIMCO Emerging Multi-Asset Fund, der PIMCO EqS Emerging Markets Fund, der PIMCO EqS Pathfinder Fund™ und der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ wurden abgewickelt. Sie haben keine Anleger mehr, und weitere Zeichnungen für die Teilfonds werden nicht mehr angenommen.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen Class H Institutional, Class E, Class G Retail, Class M Retail und Class T fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Teilfonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite kämen alle Preissenkungen für von der Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste der Verwaltungsgesellschaft und nicht den Anteilinhabern zugute. Dies betrifft u.a. geringere Kosten (in Prozent des Nettovermögens) aufgrund eines steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z-Anteile werden primär für andere Teilfonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit der Anlageberatungsgesellschaft oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für Class Z-Anteile auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

**(c) Anlageberatungsdienste**

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Teilfonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

**(d) Administrations- und Depot- sowie sonstige Dienste**

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Depot- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Depot- und Unterdepotdienste für die einzelnen Teilfonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Depotbank werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste von Notierungsmaklern, Zahlstellen und anderen Vertretern vor Ort sowie Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Teilfonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Depotbank berechnet eine vermögensabhängige Gebühr auf den NIW der einzelnen Teilfonds. Diese ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Gebühren für von der Depotbank erbrachte Treuhänder- und Compliance-Dienste errechnen sich auf Basis einer jährlichen vermögensabhängigen Gebühr auf den gesamten NIW der Teilfonds. Die Gebühren für von der Depotbank ernannte Unterdepotbanken werden zu handelsüblichen Sätzen gemeinsam mit den Transaktionsgebühren der Unterdepotbanken erhoben. Ebenfalls hat die Depotbank Anspruch auf Erstattung aller angemessenen Auslagen, die ihr im Zusammenhang mit der Erbringung ihrer Dienste für die einzelnen Teilfonds entstanden sind.

Die Gesellschaft bezahlte den Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2015 EUR 80.000 (zum 31. Dezember 2014 lag dieser Betrag bei EUR 80.000). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Die Verwaltungsratshonorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen" der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

In der folgenden Tabelle sind die von der Gesellschaft während der zum 31. Dezember 2015 und 31. Dezember 2014 abgelaufenen Berichtszeiträume in Rechnung gestellten Gebühren (einschließlich Aufwendungen) aufgeführt:

| Vergütung des Abschlussprüfers | 2015 € | 2014 € |
|---|---|---|
| Prüfung von Gesellschaftsabschlüssen | 578.633 | 532.116 |
| Sonstige Sicherungsdienste | - | - |
| Steuerberatung | - | - |
| Dienste außerhalb der Abschlussprüfung | - | - |

**Servicegebühr**

Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder

Programmen, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Teilfonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Teilfonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Service Fee hat sich von 2014 auf 2015 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Teilfonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr**
Die Bestandspflegegebühr für Anteile der Administrative Class ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilinhabern der Teilfonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Teilfondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Teilfonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der Administrative Class. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühr für den jeweiligen Teilfonds (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich auf folgenden Betrag:

| Strategie | Teilfonds | % |
|---|---|---|
| Fest verzinslich | PIMCO Asia Local Bond Fund, PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Credit Absolute Return Fund, Diversified Income Fund, Diversified Income Duration Hedged Fund, Emerging Asia Bond Fund, Emerging Local Bond Fund, Emerging Markets 2018 Fund, Emerging Markets Bond Fund, Emerging Markets Corporate Bond Fund, Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund, PIMCO Emerging Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Low Duration Fund, Euro Real Return Fund, Euro Short-Term Fund, Euro Ultra-Long Duration Fund, Global Advantage Fund, Global Advantage Real Return Fund, Global Bond Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global High Yield Bond Fund, Global Investment Grade Credit Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Income Fund, Inflation Strategy Fund, Low Average Duration Fund, Low Duration Global Investment Grade Credit Fund, Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund, Total Return Bond Fund, PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund, UK Corporate Bond Fund, UK Long Term Corporate Bond Fund, UK Low Duration Fund, UK Real Return Fund, UK Sterling Long Average Duration Fund, Unconstrained Bond Fund, US High Yield Bond Fund und US Short-Term Fund | 0,50 |
| Strategische Märkte | Commodity Real Return Fund, Global Multi-Asset Fund und Strategic Income Fund | 0,50 |
| Aktien | PIMCO Dividend and Income Builder Fund, PIMCO EqS Emerging Markets Fund, PIMCO EqS Pathfinder Fund™, PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™, PIMCO Global Dividend Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund, PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund, PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund, PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund, PIMCO RAE Fundamental US Fund und US Small Cap StocksPLUS™ Fund | 0,50 |
| Aktien | StocksPLUS™ Fund | 0,75 |

Die Bestandspflegevergütungen wurden seit 2014 nicht geändert.

Der PIMCO Asia Local Bond Fund, der PIMCO Emerging Multi-Asset Fund, der PIMCO EqS Emerging Markets Fund, der PIMCO EqS Pathfinder Fund™ und der PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ wurden abgewickelt. Sie haben keine Anleger mehr, und weitere Zeichnungen für die Teilfonds werden nicht mehr angenommen.

**(e) Vertriebsgebühr**
Die Vertriebsgebühr, die für Anteile der Class T anwendbar ist, wird an die Vertriebsstelle für Dienstleistungen bezahlt, die diese Anteilinhabern des Teilfonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilen der Class T. Die Vertriebsgebühr errechnet sich jährlich aus 0,40 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Anteile der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO Credit Absolute Return Fund, den PIMCO Dividend and Income Builder Fund, den Euro Bond Fund, den Global Bond Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den PIMCO Global Dividend Fund, den Global Low Duration Real Return Fund, den Global Real Return Fund, den PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund, den Total Return Bond Fund und den Unconstrained Bond Fund. Für diese Teilfonds wird eine Vertriebsgebühr von 0,30 % p.a. auf den NIW dieser Teilfonds bezahlt.

In Bezug auf die T Class des PIMCO Dividend and Income Builder Fund und des PIMCO Global Dividend Fund wird die Vertriebsgebühr nach Ablauf des Gebührenverzichts auf 0,15 % gesenkt, so dass sich die Gesamtgebühr ohne Berücksichtigung des Gebührenverzichts auf 2,50 % beläuft.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von Verwaltungsgebühren)**
Gemäß der geltenden Fassung des Verwaltungsvertrags zwischen der Gesellschaft und der Verwaltungsgesellschaft vom 28. Januar 1998 ist die Verwaltungsgesellschaft mit der Gesellschaft übereingekommen, die gesamten jährlichen Betriebskosten eines Teilfonds für alle Klassen des Teilfonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Teilfonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Teilfondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Teilfonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Teilfonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf den sie gemäß dem Verwaltungsvertrag während der vorangegangenen 36 Monate verzichtet oder den sie gemäß diesem reduziert oder erstattet hat (der „Erstattungsbetrag"), vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % des durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögens der Klasse des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbetrag; 3) er enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) er führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Teilfonds einen negativen Nettoertrag ausweist.

**13. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN**

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien. An diese Parteien zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 12 offengelegt.

Zum 31. Dezember 2015 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.364.825 (31. Dezember 2014: 1.345.773) Anteile des US Short-Term Fund.

Zum 31. Dezember 2015 war der Global Multi-Asset Fund in Anteile der Class Z des PIMCO Capital Securities Fund, des Emerging Markets Corporate Bond Fund, des Global Advantage Real Return Fund, des Income Fund und des StocksPLUS™ Fund investiert. Der Diversified Income Fund, der Diversified Income Duration Hedged Fund, der Emerging Asia Bond Fund, der Emerging Local Bond Fund, der Global Bond Fund, der Low Average Duration Fund, der Total Return Bond Fund und der Unconstrained Bond Fund legen in Anteile der Class Z des US Short-Term Fund an. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Z Class und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Z Class dieser Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds legen in Anteile der Class Z des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund und PIMCO China Bond Fund an, die als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Fonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds investieren in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF Fund, den PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF Fund und den PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF Fund, und diese gelten als mit der Gesellschaft verbunden. Da diese Teilfonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und dem verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Teilfonds an den Manager ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2015 und 31. Dezember 2014 kauften und verkauften die unten erwähnten Teilfonds Wertpapiere verbundener Teilfonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe in verbundenen Teilfonds vor (Angaben in Tausend):

| | 31. Dez. 2015 | |
|---|---|---|
| **Teilfonds** | **Käufe** | **Verkäufe** |
| PIMCO Asia Local Bond Fund | $ - | $ 542 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 2.430.380 | 2.682.889 |
| Commodity Real Return Fund | 58.402 | 91.753 |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | 711.324 | 1.130.624 |
| Diversified Income Fund | 631.628 | 1.525.474 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 622.848 | 555.773 |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | 146.714 | 143.990 |
| Emerging Asia Bond Fund | 54.309 | 60.862 |
| Emerging Local Bond Fund | 632.812 | 896.165 |
| Emerging Markets 2018 Fund | 1.800 | - |
| Emerging Markets Bond Fund | 2.382.419 | 2.428.014 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 707.712 | 892.207 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 95.986 | 100.091 |
| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | 65.757 | 102.003 |
| PIMCO EqS Emerging Markets Fund | 143.831 | 171.336 |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ | 47.009 | 58.743 |
| PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ | - | 1 |
| Euro Bond Fund | 65.308 | 89.478 |
| Euro Credit Fund | 135.852 | 131.563 |
| Euro Income Bond Fund | 147.979 | 173.207 |
| Euro Long Average Duration Fund | 111.834 | 90.427 |
| Euro Low Duration Fund | 28.281 | 173.602 |
| Euro Real Return Fund | - | - |
| Euro Short-Term Fund | 123.465 | 49.064 |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | 18.935 | 48.922 |

| | 31. Dez. 2015 | |
|---|---|---|
| **Teilfonds** | **Käufe** | **Verkäufe** |
| Global Advantage Fund | $ 41.557 | $ 4.372 |
| Global Advantage Real Return Fund | 498.439 | 617.049 |
| Global Bond Fund | 4.126.786 | 4.317.240 |
| Global Bond Ex-US Fund | 578.092 | 478.894 |
| PIMCO Global Dividend Fund | 62.206 | 60.998 |
| Global High Yield Bond Fund | 2.248.264 | 2.125.320 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 7.156.804 | 7.266.426 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 594.084 | 620.821 |
| Global Multi-Asset Fund | 1.569.309 | 1.510.690 |
| Global Real Return Fund | 2.120.859 | 1.924.841 |
| Income Fund | 9.671.374 | 8.993.618 |
| Inflation Strategy Fund | 64.603 | 72.867 |
| Low Average Duration Fund | 1.061.328 | 1.315.647 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 24.388 | 9.111 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 11.524 | 11.600 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 18.753 | 45.396 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | 733.064 | 923.102 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | 116.505 | 111.501 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 139.580 | 115.239 |
| StocksPLUS™ Fund | 71.717 | 176.230 |
| Strategic Income Fund | 12.211 | 19.182 |
| Total Return Bond Fund | 4.253.531 | 4.743.937 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 9.761 | 9.690 |
| UK Corporate Bond Fund | 27.538 | 49.814 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 29.262 | 73.559 |
| UK Low Duration Fund | 11.203 | 6.769 |
| UK Real Return Fund | 1.746 | 5.830 |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | 2.466 | 1.737 |
| Unconstrained Bond Fund | 1.500.048 | 1.734.610 |
| US High Yield Bond Fund | 1.485.418 | 1.396.202 |
| US Short-Term Fund | 538.120 | 451.898 |
| US Small Cap StocksPLUS™ Fund | 5.092 | 12.333 |

| | 31. Dez. 2014 | |
|---|---|---|
| **Teilfonds** | **Käufe** | **Verkäufe** |
| PIMCO Asia Local Bond Fund | $ 502 | $ - |
| PIMCO Capital Securities Fund | 2.506.471 | 2.134.951 |
| Commodity Real Return Fund | 33.992 | 6.335 |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | 480.601 | 709.762 |
| Diversified Income Fund | 5.606.049 | 3.353.799 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 1.255.633 | 951.441 |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | 169.799 | 1.602 |
| Emerging Asia Bond Fund | 49.062 | 126.848 |
| Emerging Local Bond Fund | 1.411.748 | 189.732 |
| Emerging Markets Bond Fund | 3.441.078 | 824.284 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 1.768.128 | 755.081 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 49.880 | 179.177 |
| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | 172.592 | 22.056 |
| PIMCO EqS Emerging Markets Fund | 873.172 | 3.120 |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ | 249.394 | - |
| PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ | 427 | - |
| Euro Bond Fund | 191.172 | 158.466 |
| Euro Credit Fund | 210.483 | 147.326 |
| Euro Income Bond Fund | 263.377 | 98.590 |
| Euro Long Average Duration Fund | 112.247 | 100.118 |
| Euro Low Duration Fund | 87.255 | 310.233 |
| Euro Real Return Fund | 387 | - |
| Euro Short-Term Fund | 168.467 | 16.661 |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | 31.802 | 35.707 |
| Global Advantage Fund | 522.488 | 115.905 |

| Teilfonds | 31. Dez. 2014 Käufe | Verkäufe |
|---|---|---|
| Global Advantage Real Return Fund | $ 424.493 | $ 17.356 |
| Global Bond Fund | 6.399.413 | 545.554 |
| Global Bond Ex-US Fund | 566.667 | 42.734 |
| PIMCO Global Dividend Fund | 608.645 | 2.173 |
| Global High Yield Bond Fund | 2.766.810 | 620.893 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 5.916.622 | 2.494.803 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 323.100 | 278.304 |
| Global Multi-Asset Fund | 1.813.050 | 1.209.470 |
| Global Real Return Fund | 1.543.091 | 55.128 |
| Income Fund | 3.196.020 | 293.955 |
| Inflation Strategy Fund | 35.280 | 998 |
| Low Average Duration Fund | 974.044 | 946.273 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 6.030 | 2.290 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 13.800 | 6.880 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 10.691 | 53.949 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | 227.066 | 54.874 |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | 35.458 | 3.510 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 231.412 | 25.842 |
| StocksPLUS™ Fund | 326.394 | 32.814 |
| Strategic Income Fund | 20.484 | 8.415 |
| Total Return Bond Fund | 6.002.023 | 3.711.160 |
| UK Corporate Bond Fund | 74.927 | 80.347 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 47.857 | 183.349 |
| UK Low Duration Fund | 14.732 | 9.873 |
| UK Real Return Fund | 2.456 | 2.848 |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | 1.652 | 1.495 |
| Unconstrained Bond Fund | 3.941.894 | 1.200.295 |
| US High Yield Bond Fund | 1.514.528 | 321.687 |
| US Short-Term Fund | 357.302 | 195.064 |

In der folgenden Tabelle sind die umlaufenden Anteile aufgeführt, die zum 31. Dezember 2015 und zum 31. Dezember 2014 von der Allianz Group als verbundene Parteien der Gesellschaft gehalten wurden und jeweils mehr als 20 % der Gesamtanteile eines Teilfonds ausmachen.

| Teilfonds | 2015 % Gehalten | 2014 % Gehalten |
|---|---|---|
| PIMCO Asia Local Bond Fund | k. A. | 91,94 |
| Emerging Markets 2018 Fund | 84,23 | 97,37 |
| Emerging Markets Bond Fund | 35,08 | 24,81 |
| Euro Low Duration Fund | 21,90 | 0,00 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 32,88 | 1,46 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,00 | 58,28 |
| PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund | 100,00 | k. A. |
| PIMCO RAE Fundamental Europe Fund | 81,89 | k. A. |
| PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund | 98,10 | k. A. |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 73,74 | 7,67 |
| PIMCO RAE Fundamental US Fund | 74,86 | k. A. |
| Strategic Income Fund | 30,15 | 7,39 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 86,92 | k. A. |

### 14. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Teilfonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 31. Dezember 2015 geltenden Wechselkurs von Euro in USD (USD/EUR 0,92056) (31. Dezember 2014 USD/EUR 0,82641) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,67847) (31. Dezember 2014 USD/GBP 0,64133) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen Wechselkurs während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2015 von Euro in USD (USD/EUR 0,90123) (31. Dezember 2014 USD/EUR 0,75273) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,65436) (31. Dezember 2014 USD/GBP 0,60702) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die am 31. Dezember 2015 und am 31. Dezember 2014 für die Umrechnung in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar verwendeten Wechselkurse wieder. Diese wurden ebenfalls verwendet, um die Anlagen sowie sonstigen Aktiva und Passiva, die nicht auf Pfund Sterling, Euro und US-Dollar lauten, umzurechnen.

| Fremdwährung | 2015 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| AED | k. A. | k. A. | 3,67300 |
| ARS | k. A. | k. A. | 12,94500 |
| AUD | 1,49309 | 2,02584 | 1,37448 |
| BRL | 4,29767 | 5,83112 | 3,95625 |
| CAD | 1,50898 | 2,04739 | 1,38910 |
| CHF | 1,08739 | 1,47537 | 1,00100 |
| CLP | 769,75226 | k. A. | 708,60000 |
| CNH | 7,13585 | 9,68198 | 6,56895 |
| CNY | 7,05400 | 9,57092 | 6,49360 |
| COP | k. A. | k. A. | 3.174,50000 |
| CZK | 27,02204 | k. A. | 24,87530 |
| DKK | 7,46266 | 10,12540 | 6,86980 |
| EUR (oder €) | 1,00000 | 1,35681 | 0,92056 |
| GBP (oder £) | 0,73702 | 1,00000 | 0,67847 |
| HKD | k. A. | 11,42295 | 7,75015 |
| HUF | 316,00507 | k. A. | 290,90035 |
| IDR | 14.974,64600 | k. A. | 13.785,00000 |
| ILS | 4,22685 | k. A. | 3,89105 |
| INR | 71,86553 | k. A. | 66,15625 |
| ITL | 1.936,27002 | k. A. | 1.782,44500 |
| JPY | 130,67646 | 177,30280 | 120,29500 |
| KRW | 1.273,74109 | 1.728,22150 | 1.172,55000 |
| MXN | 18,76165 | 25,45595 | 17,27115 |
| MYR | 4,66403 | 6,32819 | 4,29350 |
| NGN | k. A. | k. A. | 199,05000 |
| NOK | 9,61522 | 13,04601 | 8,85135 |
| NZD | 1,58677 | 2,15294 | 1,46071 |
| PEN | k. A. | k. A. | 3,41145 |
| PHP | k. A. | k. A. | 47,05500 |
| PLN | 4,28974 | 5,82036 | 3,94895 |
| QAR | k. A. | k. A. | 3,64230 |
| RON | k. A. | k. A. | 4,16230 |
| RUB | 79,33794 | k. A. | 73,03500 |
| SEK | 9,15816 | 12,42586 | 8,43060 |
| SGD | 1,54108 | 2,09095 | 1,41865 |
| THB | 39,09051 | 53,03829 | 35,98500 |
| TRY | 3,17075 | 4,30209 | 2,91885 |
| TWD | 35,68170 | 48,41319 | 32,84700 |
| USD (oder $) | 1,08630 | 1,47390 | 1,00000 |
| UYU | k. A. | k. A. | 29,91500 |
| ZAR | 16,83276 | 22,83882 | 15,49550 |

| Fremdwährung | 2014 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| AED | k. A. | k. A. | 3,67300 |
| AUD | 1,47865 | 1,90536 | 1,22197 |
| BRL | 3,21656 | 4,14480 | 2,65820 |
| CAD | 1,40154 | 1,80600 | 1,15825 |
| CHF | 1,20237 | 1,54935 | 0,99365 |
| CLP | 734,31893 | k. A. | 606,85000 |
| CNH | k. A. | k. A. | 6,21790 |
| CNY | k. A. | k. A. | 6,20400 |
| COP | k. A. | k. A. | 2.376,50000 |
| CZK | k. A. | k. A. | 22,90400 |
| DEM | 1,95583 | k. A. | k. A. |
| DKK | 7,44635 | 9,59524 | 6,15375 |
| EUR (oder €) | k. A. | 1,28858 | 0,82641 |
| GBP (oder £) | 0,77605 | k. A. | 0,64133 |

| | 2014 Präsentationswährung | | |
|---|---|---|---|
| Fremdwährung | EUR | GBP | USD |
| HKD | 9,38376 | 12,09175 | 7,75485 |
| HUF | 315,75007 | k. A. | 260,93965 |
| IDR | k. A. | k. A. | 12.385,00000 |
| ILS | 4,70885 | k. A. | 3,89145 |
| INR | 76,38138 | 98,42376 | 63,12250 |
| JPY | 145,07895 | 186,94628 | 119,89500 |
| KRW | k. A. | k. A. | 1.099,15000 |
| LKR | k. A. | k. A. | 131,20000 |
| MXN | 17,83583 | 22,98296 | 14,73975 |
| MYR | 4,23094 | 5,45192 | 3,49650 |
| NGN | k. A. | k. A. | 183,00000 |
| NOK | 9,07241 | 11,69056 | 7,49755 |
| NZD | 1,54817 | 1,99495 | 1,27943 |
| PEN | k. A. | k. A. | 2,97650 |
| PHP | k. A. | k. A. | 44,73250 |
| PLN | 4,29810 | 5,53846 | 3,55200 |
| QAR | k. A. | k. A. | 3,64135 |
| RON | k. A. | k. A. | 3,70535 |
| RUB | 72,60302 | k. A. | 60,00000 |
| SEK | 9,47257 | 12,20620 | 7,82825 |
| SGD | 1,60344 | k. A. | 1,32510 |
| THB | 39,81065 | k. A. | 32,90000 |
| TRY | 2,82879 | 3,64514 | 2,33775 |
| TWD | k. A. | k. A. | 31,60200 |
| USD (oder $) | 1,21005 | 1,55925 | k. A. |
| UYU | k. A. | k. A. | 24,31500 |
| ZAR | 13,99877 | 18,03857 | 11,56875 |

**15. FINANZIELLE RISIKEN**

Die Hauptrisiken, die sich aus den Finanzinstrumenten der Gesellschaft ergeben, sind das Marktpreis-, Devisen-, Zinssatz-, Liquiditäts- und Kredit- und Kontrahentenrisiko. Die Risiken in Verbindung mit Teilfonds, die während des Berichtszeitraums geschlossen wurden, stimmen mit den Vergleichsinformationen für 31. Dezember 2014 bis zum Datum der Abwicklung überein.

**(a) Marktpreisrisiko** Das Marktrisiko ergibt sich hauptsächlich aus der Unsicherheit der künftigen Kurse der gehaltenen Finanzinstrumente. Es stellt den potenziellen Verlust dar, der dem Teilfonds entstehen könnte, wenn Marktpositionen bei nachteiligen Kursbewegungen gehalten werden. Die Anlageberatungsgesellschaften prüfen die Vermögensstrukturierung des Portfolios, um das mit bestimmten Ländern oder Industriezweigen verbundene Risiko zu minimieren, während sie weiterhin die Anlageziele der Teilfonds verfolgen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwenden eine Reihe quantitativer Techniken, um die Auswirkungen von Marktrisiken, einschließlich Kreditereignisse, Zinssatzänderungen, Kreditspreads und Beitreibungswerte, auf das Anlageportfolio der Teilfonds zu bewerten.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwendeten die Risikopotenzialanalyse (Value at Risk, „VaR"), eine von Finanzinstituten weitgehend eingesetzte Technik zur Messung, Bewertung und Darstellung des Marktrisikos. Das VaR ist ein statistischer Rahmen, der die Quantifizierung des Marktrisikos in einem Portfolio mit einem bestimmten Konfidenzintervall in einem festgelegten Haltezeitraum unterstützt. Bestimmte Teilfonds dürfen das relative VaR-Modell oder das absolute VaR-Modell verwenden. Bei Einsatz des relativen VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Teilfondsportfolios das doppelte Risikopotenzial eines vergleichbaren Benchmark-Portfolios oder Referenzportfolios (d. h. eines ähnlichen Portfolios ohne Derivate) nicht überschreiten, welches das angestrebte Anlageverhalten des jeweiligen Teilfonds wiedergibt.

Bei Einsatz des absoluten VaR-Modells darf das Risikopotenzial eines Teilfondsportfolios 20 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nicht übersteigen und die Haltedauer beträgt 20 Tage, wobei die Datenhistorie mindestens ein Jahr beträgt. Das VaR soll die erwarteten maximalen Verluste in Dollar messen, die aus dem interaktiven Verhalten aller wesentlichen Marktkurse, Spreads, Schwankungen, Zinssätze sowie anderer Risiken, einschließlich des Devisen-, Zinssatz- Schwellenmarkt- und Konvexitätsrisikos, die aus den historisch beobachteten Verhältnissen zwischen diesen Märkten resultieren können.

Obwohl der Einsatz von Derivaten zu zusätzlichen Fremdkapitalrisiken führen kann, wird jedes derartige zusätzliche Risiko mithilfe der VaR-Methode in Übereinstimmung mit den Anforderungen der Zentralbank gesichert und gesteuert. Die Anlageberatungsgesellschaften überwachen das Portfoliorisiko täglich mithilfe von Marktfaktoranalysen. Mögliche Marktrisiken werden mit dem parametrischen delta-normalen oder Faktormodellansatz berechnet. Das VaR wird auf Grundlage der Schlusspreise und der Marktinformationen des vorhergehenden Geschäftstages täglich automatisch berechnet und dargestellt. In Abhängigkeit von der Anwendung der Risikostatistiken könnten verschiedene Konfidenzniveaus (z.B. 99 %) und Zeithorizonte (Wochen oder Monate) ausgewählt werden.

Stresstests werden in Bezug auf das VaR-Modell für jeden Teilfonds monatlich durchgeführt. Die PIMCO Risk Group überwacht die Zusammensetzung der Stresstests und nimmt die entsprechenden Änderungen vor, wenn dies aufgrund der Marktbedingungen und Zusammensetzung des jeweiligen Teilfonds angebracht ist. Mit den Stresstests werden potenzielle Gewinne oder Verluste aufgrund von Schocks bei finanziellen Variablen geschätzt, wie unter anderem Nominalzinsen für Staatsanleihen, Nominalzinsen für Swaps, Realzinsen, Credit-Spreads, Aktienbewertungen, Rohstoffwerten, Wechselkurse und implizierte Volatilitäten. Abgesehen von den monatlich durchgeführten Stresstests werden drei zusätzliche Arten von Stresstests durchgeführt, von denen einige täglich und einige interaktiv für Analysen verwendet werden. Der erste Test umfasst einen Szenario-Auswirkungs-Test, der die Auswirkungen von unerwarteten Ertragsbewegungen im Markt auf den Wert des Portfolios ermittelt. Diese Durationen werden an jedem Geschäftstag berechnet. Der zweite Test legt eine Datenbank historischer Krisenszenarios zugrunde und untersucht die Reaktionen auf solche Krisen. Die historischen Krisenszenarien enthalten viele unerwartete Veränderungen der Marktbedingungen und Korrelationsmatritzen. Der dritte Test enthält Korrelationsmatrizen, die manuell verändert werden können, um in der Zukunft mögliche Bedingungen zu simulieren, die bisher allerdings noch nicht eingetreten sind.

Berechnungen werden allgemein mithilfe automatischer Simulationsmethoden durchgeführt. Allerdings sind auch Methoden zur manuellen Überprüfung von Änderungen an den Korrelationsmatrizen vorhanden, die sich auf die Portfolios in erheblichem Umfang negativ auswirken würden. Diese Korrelationsänderungen können dann analysiert werden und mögliche, tatsächlich vorkommende Ereignisse, durch die solche Änderungen verursacht werden, können zugeordnet werden.

Natürlich kann nicht ausgeschlossen werden, dass sich tatsächliche wirtschaftliche Ergebnisse von den manuellen und automatischen Szenarios unterscheiden.

Die täglichen VaR-Messungen sind eine Schätzung des Portfolioverlusts für den folgenden Monat, der nach den Annahmen des VaR-Modells 99 % der Zeit nicht überschritten wird.

Nicht alle Risiken, denen das Portfolio ausgesetzt sein kann, sollen vom VaR erfasst werden. Insbesondere will das System nicht das Liquiditätsrisiko, das Kontrahentenrisiko oder extreme Kreditereignisse wie Emittentenverzug erfassen. In der Praxis weichen die tatsächlichen Handelsergebnisse vom VaR ab und vermitteln eventuell keine aussagekräftige Indikation der Gewinne und Verluste in angespannten Marktverhältnissen. Um die Zuverlässigkeit der VaR-Modelle zu bestimmen, werden tatsächliche Ergebnisse überwacht, um die Gültigkeit der für die VaR-Berechnung verwendeten Annahmen und Parameter zu prüfen. Marktrisikopositionen werden ebenfalls regelmäßigen Stresstests unterzogen, um sicherzustellen, dass die einzelnen Teilfonds einem extremen Marktereignis standhalten können.

In den folgenden Tabellen werden der minimale, maximale, durchschnittliche VaR und der VaR zum Ende des Berichtszeitraums der einzelnen Teilfonds zum 31. Dezember 2015 und zum 31. Dezember 2014 aufgeführt:

| | | | 31. Dez. 2015 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Teilfonds | Methode | Vergleichsindex | Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
| PIMCO Capital Securities Fund | Absolut | k. A. | 4,28 % | 7,57 % | 5,67 % | 6,29 % |
| Commodity Real Return Fund | Relativ | Bloomberg Commodity Index Total Return | 96,85 % | 116,55 % | 107,76 % | 108,47 % |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | Absolut | k. A. | 2,44 % | 3,66 % | 3,06 % | 3,12 % |

| Teilfonds | Methode | Vergleichsindex | 31. Dez. 2015 Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Diversified Income Fund[1] | Relativ | jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index und JPMorgan EMBI Global | 104,58 % | 134,14 % | 114,65 % | 113,43 % |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Absolut | k. A. | 5,60 % | 9,95 % | 7,46 % | 8,14 % |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | Relativ | 75 % MSCI All Country World Index Net USD/25 % Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index | 103,67 % | 128,91 % | 119,83 % | 125,36 % |
| Emerging Asia Bond Fund | Relativ | [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR] | 97,01 % | 108,14 % | 102,17 % | 103,31 % |
| Emerging Local Bond Fund | Relativ | JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | 97,54 % | 110,38 % | 102,79 % | 100,16 % |
| Emerging Markets 2018 Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 41,12 % | 154,72 % | 57,53 % | 51,89 % |
| Emerging Markets Bond Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 107,96 % | 148,50 % | 122,02 % | 125,90 % |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Relativ | JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified | 120,99 % | 159,45 % | 132,97 % | 131,50 % |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund[1] | Relativ | JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (ELMI+) | 98,28 % | 122,42 % | 106,71 % | 108,90 % |
| Euro Bond Fund | Relativ | Citi Euro Broad Investment-Grade Index | 99,31 % | 145,81 % | 116,38 % | 104,42 % |
| Euro Credit Fund | Relativ | Barclays Euro-Aggregate Credit Index | 100,74 % | 146,63 % | 115,26 % | 119,43 % |
| Euro Income Bond Fund | Relativ | 50 % Barclays Pan-Euro High Yield, 50 % Euro-Aggregate | 120,31 % | 199,29 % | 142,15 % | 120,51 % |
| Euro Long Average Duration Fund | Relativ | Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | 91,50 % | 104,84 % | 96,68 % | 96,09 % |
| Euro Low Duration Fund | Absolut | k. A. | 0,62 % | 1,40 % | 0,88 % | 0,90 % |
| Euro Real Return Fund | Relativ | Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond Index | 87,10 % | 119,30 % | 106,05 % | 109,10 % |
| Euro Short-Term Fund | Absolut | k. A. | 0,24 % | 1,00 % | 0,49 % | 0,48 % |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | Relativ | Barclays 20 Yr, 25 Yr, 30 Yr and 35 Yr Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index | 91,05 % | 101,31 % | 97,91 % | 99,04 % |
| Global Advantage Fund | Relativ | PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) | 95,23 % | 123,21 % | 106,03 % | 104,82 % |
| Global Advantage Real Return Fund | Relativ | PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged) | 97,72 % | 125,74 % | 107,33 % | 111,51 % |
| Global Bond Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index | 87,17 % | 127,68 % | 108,03 % | 102,71 % |
| Global Bond Ex-US Fund[1] | Relativ | Citi World Government Bond Ex-US Index (USD Hedged) | 95,20 % | 132,67 % | 109,12 % | 100,00 % |
| PIMCO Global Dividend Fund | Relativ | MSCI All Country World Index | 94,56 % | 124,83 % | 102,22 % | 104,10 % |
| Global High Yield Bond Fund | Relativ | BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD | 100,11 % | 124,25 % | 106,64 % | 104,82 % |
| Global Investment Grade Credit Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | 92,85 % | 117,62 % | 101,42 % | 102,92 % |
| Global Low Duration Real Return Fund | Relativ | Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | 96,05 % | 183,34 % | 133,93 % | 145,44 % |
| Global Multi-Asset Fund | Relativ | 60 % MSCI All Country World Index/40 % Barclays Global Aggregate USD Hedged | 104,45 % | 134,54 % | 119,58 % | 119,57 % |
| Global Real Return Fund | Relativ | Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index | 91,67 % | 107,01 % | 100,73 % | 103,68 % |
| Income Fund | Relativ | Barclays US Aggregate Index | 94,37 % | 148,89 % | 122,03 % | 139,06 % |
| Inflation Strategy Fund | Absolut | k. A. | 4,43 % | 8,13 % | 5,85 % | 6,14 % |
| Low Average Duration Fund | Absolut | k. A. | 0,99 % | 1,86 % | 1,30 % | 1,26 % |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged) | 114,56 % | 234,75 % | 152,77 % | 140,48 % |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Relativ | Alerian MLP Index (USD Unhedged) | 67,72 % | 95,49 % | 86,99 % | 91,79 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | Relativ | MSCI Emerging Markets Index | 104,30 % | 133,17 % | 120,56 % | 119,58 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | Relativ | MSCI World Index | 112,48 % | 127,21 % | 118,95 % | 121,56 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | Relativ | S&P 500 Index | 105,44 % | 117,61 % | 109,33 % | 109,04 % |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter | 106,08 % | 146,70 % | 120,01 % | 115,55 % |
| StocksPLUS℠ Fund | Relativ | S&P 500 Index | 100,10 % | 110,30 % | 103,16 % | 103,43 % |
| Strategic Income Fund | Relativ | 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index | 98,84 % | 176,98 % | 153,19 % | 174,88 % |
| Total Return Bond Fund | Relativ | Barclays US Aggregate Index | 72,53 % | 108,22 % | 92,36 % | 85,69 % |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| Teilfonds | Methode | Vergleichsindex | 31. Dez. 2015 Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Absolut | k. A. | 1,50 % | 11,24 % | 5,28 % | 4,03 % |
| UK Corporate Bond Fund | Relativ | BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 97,76 % | 110,20 % | 103,93 % | 107,20 % |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Relativ | Bofa Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index | 97,96 % | 109,80 % | 101,73 % | 102,53 % |
| UK Low Duration Fund | Absolut | k. A. | 0,94 % | 1,97 % | 1,42 % | 1,45 % |
| UK Real Return Fund | Relativ | FTSE Actuaries Government Securities UK Index Linked Gilts > 5 Years | 90,76 % | 103,08 % | 98,49 % | 100,52 % |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | Relativ | FTSE Actuaries Government Securities UK Gilts All Stocks > 15 Years | 86,74 % | 104,03 % | 97,10 % | 99,21 % |
| Unconstrained Bond Fund | Absolut | k. A. | 2,01 % | 3,64 % | 2,84 % | 3,60 % |
| US High Yield Bond Fund | Relativ | BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index | 94,64 % | 116,46 % | 101,07 | 101,61 % |
| US Short-Term Fund | Absolut | k. A. | 0,81 % | 2,31 % | 1,47 % | 1,81 % |
| US Small Cap StocksPLUS™ Fund | Relativ | Russell 2000® Index | 97,84 % | 106,35 % | 103,15 % | 104,61 % |

(1) Der Teilfonds änderte während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2015 die Vergleichsindexe.

| Teilfonds | Methode | Vergleichsindex | 31. Dez. 2014 Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia Local Bond Fund | Relativ | HSBC Asian Local Bond Index | 97,64 % | 109,91 % | 101,56 % | 99,43 % |
| PIMCO Capital Securities Fund | Absolut | k. A. | 3,06 % | 5,72 % | 4,07 % | 5,04 % |
| Commodity Real Return Fund(1) | Relativ | Bloomberg Commodity Index Total Return | 99,93 % | 104,61 % | 102,37 % | 101,72 % |
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | Absolut | k. A. | 1,52 % | 3,52 % | 2,17 % | 3,47 % |
| Diversified Income Fund | Relativ | Jeweils 1/3 Barclays Global Aggregate Credit Component, BofA Merrill Lynch Global High Yield BB-B Rated Constrained, JPMorgan EMBI Global; alle in USD besichert | 96,49 % | 127,20 % | 107,85 % | 123,94 % |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Absolut | k. A. | 4,07 % | 9,25 % | 5,39 % | 8,96 % |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | Relativ | 75 % MSCI All Country World Index Net USD/25 % Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index | 103,66 % | 131,26 % | 122,06 % | 122,68 % |
| Emerging Asia Bond Fund | Relativ | [90 % JPMorgan Asia Credit Index (JACI) + 10 % 1 month USD LIBOR] * [JPMorgan Emerging Local Markets Index (ELMI+)] / [3 month USD LIBOR] | 90,77 % | 110,60 % | 99,75 % | 106,12 % |
| Emerging Local Bond Fund | Relativ | JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | 98,01 % | 109,16 % | 102,13 % | 103,74 % |
| Emerging Markets 2018 Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 40,99 % | 67,32 % | 54,32 % | 66,53 % |
| Emerging Markets Bond Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 95,97 % | 130,68 % | 106,32 % | 130,68 % |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Relativ | JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 90,19 % | 155,61 % | 107,11 % | 145,62 % |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus +Bid (Unhedged) | 104,17 % | 117,87 % | 110,27 % | 104,17 % |
| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | Relativ | 50 % MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD), 25 % JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global, 25 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | 91,94 % | 112,38 % | 104,15 % | 105,55 % |
| PIMCO EqS Emerging Markets Fund | Relativ | MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | 92,03 % | 107,11 % | 100,01 % | 100,76 % |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ | Relativ | MSCI World Index | 83,34 % | 103,24 % | 90,01 % | 89,59 % |
| PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ | Relativ | MSCI Europe Index | 77,88 % | 107,77 % | 92,59 % | 96,12 % |
| Euro Bond Fund | Relativ | Citi Euro Broad Investment-Grade Index | 108,76 % | 147,81 % | 120,68 % | 127,50 % |
| Euro Credit Fund | Relativ | Barclays Euro-Aggregate Credit Index | 93,74 % | 128,31 % | 106,35 % | 110,30 % |
| Euro Income Bond Fund | Relativ | 50 % Barclays Pan-Euro High Yield, 50 % Euro-Aggregate | 93,00 % | 166,92 % | 123,33 % | 164,13 % |
| Euro Long Average Duration Fund | Relativ | Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index | 90,14 % | 100,87 % | 94,98 % | 93,42 % |
| Euro Low Duration Fund(2) | Absolut | k. A. | 0,79 % | 0,90 % | 0,84 % | 0,88 % |
| Euro Real Return Fund | Relativ | Barclays Euro Government (AAA + AA) Inflation-Linked Bond Index | 90,90 % | 125,88 % | 100,58 % | 112,62 % |
| Euro Short-Term Fund | Absolut | k. A. | 0,29 % | 0,84 % | 0,50 % | 0,77 % |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | Relativ | Barclays 20 Yr, 25 Yr, 30 Yr and 35 Yr Nominal Swap Zero Coupon EUR Total Return Index | 84,51 % | 97,15 % | 93,70 % | 84,51 % |
| Global Advantage Fund | Relativ | PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) | 104,87 % | 126,36 % | 114,25 % | 109,34 % |
| Global Advantage Real Return Fund | Relativ | PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged) | 104,84 % | 120,67 % | 110,78 % | 115,97 % |
| Global Bond Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index | 83,88 % | 164,80 % | 110,44 % | 106,46 % |
| Global Bond Ex-US Fund | Relativ | Citi World Government Bond Ex-US Index (USD Hedged) | 83,08 % | 180,01 % | 115,34 % | 107,02 % |

| Teilfonds | Methode | Vergleichsindex | 31. Dez. 2014 Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Global Dividend Fund[1] | Relativ | MSCI All Country World Index | 89,86 % | 123,65 % | 105,54 % | 112,12 % |
| Global High Yield Bond Fund[1] | Relativ | BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD | 83,54 % | 120,17 % | 97,47 % | 109,40 % |
| Global Investment Grade Credit Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | 92,23 % | 119,33 % | 104,78 % | 105,03 % |
| Global Low Duration Real Return Fund | Relativ | Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | 89,76 % | 163,17 % | 126,22 % | 153,43 % |
| Global Multi-Asset Fund | Relativ | 60 % MSCI World Index/40 % Barclays Global Aggregate Index (USD Hedged) | 78,19 % | 142,73 % | 114,72 % | 120,95 % |
| Global Real Return Fund | Relativ | Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index | 91,85 % | 128,26 % | 108,05 % | 92,62 % |
| Income Fund | Relativ | Barclays US Aggregate Index | 119,32 % | 150,43 % | 129,99 % | 150,43 % |
| Inflation Strategy Fund | Absolut | k. A. | 4,75 % | 6,85 % | 5,46 % | 5,65 % |
| Low Average Duration Fund | Absolut | k. A. | 0,98 % | 2,45 % | 1,52 % | 1,37 % |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Relativ | Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged) | 104,48 % | 220,54 % | 159,09 % | 189,66 % |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Relativ | Alerian MLP Index (USD Unhedged) | 40,37 % | 79,78 % | 61,93 % | 70,02 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | Relativ | MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | 111,32 % | 125,54 % | 117,10 % | 125,29 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | Relativ | MSCI World Index | 103,97 % | 125,50 % | 117,60 % | 115,12 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | Relativ | S&P 500 Index | 32,64 % | 117,21 % | 109,67 % | 106,23 % |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Relativ | JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter | 96,64 % | 127,11 % | 107,08 % | 127,11 % |
| StocksPLUS™ Fund | Relativ | S&P 500 Index | 91,92 % | 108,63 % | 98,44 % | 101,04 % |
| Strategic Income Fund | Relativ | 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index | 76,26 % | 129,95 % | 104,74 % | 107,92 % |
| Total Return Bond Fund | Relativ | Barclays US Aggregate Index | 70,61 % | 131,91 % | 107,19 % | 96,85 % |
| UK Corporate Bond Fund | Relativ | BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 96,86 % | 110,19 % | 102,02 % | 99,45 % |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Relativ | Bofa Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index | 97,05 % | 107,58 % | 99,54 % | 102,68 % |
| UK Low Duration Fund[2] | Absolut | k. A. | 1,11 % | 1,44 % | 1,24 % | 1,33 % |
| UK Real Return Fund | Relativ | FTSE Actuaries Government Securities UK Index Linked Gilts > 5 Years | 95,14 % | 102,88 % | 98,29 % | 100,48 % |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | Relativ | FTSE Actuaries Government Securities UK Gilts All Stocks > 15 Years | 85,85 % | 149,20 % | 95,19 % | 102,24 % |
| Unconstrained Bond Fund | Absolut | k. A. | 1,59 % | 3,39 % | 2,30 % | 2,34 % |
| US High Yield Bond Fund | Relativ | BofA Merrill Lynch US High Yield BB-B Rated Constrained Index | 87,23 % | 114,66 % | 98,80 % | 101,50 % |
| US Short-Term Fund | Absolut | k. A. | 0,06 % | 1,61 % | 0,84 % | 1,55 % |

(1) Der Teilfonds änderte während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2014 die Vergleichsindexe.
(2) Die Methodologie des Teilfonds änderte sich während des Berichtszeitraums zum 31. Dezember 2014 von relativ auf absolut.

Die folgende Sensitivitätsanalyse bezüglich der Teilfonds PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund und PIMCO RAE Fundamental US Fund geht von der Annahme aus, dass sich der Marktpreis von Anlagen verändert, während alle anderen Variablen konstant gehalten werden. In der Praxis ist es unwahrscheinlich, dass dies eintreten würde, und Änderungen an einigen der Variablen könnten korrelieren. Da die Sensitivitätsanalyse zudem historische Daten als Basis für die Bestimmung künftiger Ereignisse verwendet, berücksichtigt sie nicht alle möglichen Szenarien. Das gilt insbesondere für Extremsituationen.

Hätte sich der Marktpreis von Anlagen zum 31. Dezember 2015 um 5 % erhöht oder verringert, so hätte sich das Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber bei Annahme ansonsten konstanter Variablen ungefähr um die folgenden Beträge erhöht oder verringert (Angaben in Tausend):

| Teilfonds | Auswirkungen auf den Nettoinventarwert Zunahme | Abnahme |
|---|---|---|
| PIMCO RAE Fundamental Europe Fund | € 1.406 | € (1.406) |
| PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund | 474 | (474) |
| PIMCO RAE Fundamental US Fund | 641 | (641) |

Der PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund wendet den Commitment-Ansatz an, und die Hebelung beträgt maximal 100 % des Nettoinventarwerts des Fonds.

In der folgenden Tabelle werden das minimale, das maximale und das durchschnittliche Engagement sowie das Engagement zum Ende des Berichtszeitraums des Teilfonds zum 31. Dezember 2015 aufgeführt:

| 31. Dez. 2015 Min. | Max. | Durchschnitt | Berichtszeitraumende |
|---|---|---|---|
| 3,59 % | 11,99 % | 7,15 % | 3,76 % |

Die Zentralbank verlangt, dass alle OGAW-Fonds ein Maß für die Fremdfinanzierung offenlegen, das aufgrund eines nominellen Brutto-Engagements berechnet wird. Die Höhe des nominellen Bruttoengagements wird, wie von der Zentralbank gefordert, mithilfe der Summe der absoluten Werte der Nominalwerte der eingesetzten Derivate berechnet (wobei davon ausgegangen wird, dass bestimmte Terminkontrakte enthalten sind) und berücksichtigt daher keine vom Teilfonds eingegangenen Netting- und Absicherungsvereinbarungen. Der Einsatz von Derivaten (ob für Absicherungs- oder Anlagezwecke) kann zu einem höheren nominellen Brutto-Engagement führen. Es wird erwartet, dass das nominelle Brutto-Engagement der Teilfonds auf höhere Werte ansteigt, wenn es die Anlageberatungsgesellschaften beispielsweise für angemessen halten, Derivate zur Änderung des Zinssatzes, des Währungs- oder Kreditengagements des Teilfonds einzusetzen.

In der folgenden Tabelle werden die durchschnittlichen nominellen Brutto-Engagements für die Teilfonds für die Berichtszeiträume zum 31. Dezember 2015 und 31. Dezember 2014 aufgeführt:

| Teilfonds | 31. Dez. 2015* | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| PIMCO Asia Local Bond Fund | k. A. | 136 % |
| PIMCO Capital Securities Fund | 139 % | 107 % |
| Commodity Real Return Fund | 300 % | 253 % |

| Teilfonds | 31. Dez. 2015* | 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| PIMCO Credit Absolute Return Fund | 213 % | 168 % |
| Diversified Income Fund | 123 % | 142 % |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 172 % | 167 % |
| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | 33 % | 1 % |
| Emerging Asia Bond Fund | 232 % | 321 % |
| Emerging Local Bond Fund | 238 % | 167 % |
| Emerging Markets 2018 Fund | 8 % | 3 % |
| Emerging Markets Bond Fund | 77 % | 64 % |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 42 % | 40 % |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 277 % | 319 % |
| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | k. A. | 42 % |
| PIMCO EqS Emerging Markets Fund | k. A. | 170 % |
| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ | k. A. | 161 % |
| PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ | k. A. | 61 % |
| Euro Bond Fund | 403 % | 343 % |
| Euro Credit Fund | 261 % | 240 % |
| Euro Income Bond Fund | 237 % | 204 % |
| Euro Long Average Duration Fund | 272 % | 274 % |
| Euro Low Duration Fund | 113 % | 75 % |
| Euro Real Return Fund | 89 % | 114 % |
| Euro Short-Term Fund | 48 % | 52 % |
| Euro Ultra-Long Duration Fund | 344 % | 369 % |
| Global Advantage Fund | 402 % | 346 % |
| Global Advantage Real Return Fund | 385 % | 197 % |
| Global Bond Fund | 410 % | 396 % |
| Global Bond Ex-US Fund | 445 % | 468 % |
| PIMCO Global Dividend Fund | 39 % | 47 % |
| Global High Yield Bond Fund | 47 % | 60 % |
| Global Investment Grade Credit Fund | 222 % | 200 % |
| Global Low Duration Real Return Fund | 302 % | 183 % |
| Global Multi-Asset Fund | 524 % | 506 % |
| Global Real Return Fund | 424 % | 314 % |
| Income Fund | 132 % | 110 % |
| Inflation Strategy Fund | 394 % | 306 % |
| Low Average Duration Fund | 207 % | 279 % |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 149 % | 156 % |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 77 % | 56 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | 831 % | 420 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | 761 % | 392 % |
| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | 549 % | 320 % |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 60 % | 61 % |
| StocksPLUS™ Fund | 363 % | 207 % |
| Strategic Income Fund | 59 % | 10 % |
| Total Return Bond Fund | 377 % | 298 % |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 704 %(1) | k. A. |
| UK Corporate Bond Fund | 106 % | 108 % |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 102 % | 89 % |
| UK Low Duration Fund | 220 % | 164 % |
| UK Real Return Fund | 325 % | 225 % |
| UK Sterling Long Average Duration Fund | 428 % | 384 % |
| Unconstrained Bond Fund | 722 % | 433 % |
| US High Yield Bond Fund | 11 % | 18 % |
| US Short-Term Fund | 215 % | 204 % |
| US Small Cap StocksPLUS™ Fund | 536 %(1) | k. A. |

(1) Bewertet zum 31. Dezember 2015, da die Teilfonds am 31. Dezember 2015 aufgelegt wurden.

* Für die folgenden Fonds sind keine Beträge angegeben: PIMCO RAE Fundamental Europe Fund, PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund und PIMCO RAE Fundamental US Fund, da diese keine OTC Finanzderivate enthalten.

**(b) Devisenrisiko** Legen die Teilfonds direkt in Fremdwährungen oder Wertpapiere an, die in Fremdwährungen gehandelt werden und Einnahmen davon erhalten, oder in Finanzderivaten, die Beteiligungen an Fremdwährungen bieten, unterliegen sie dem Risiko, dass der Wert dieser Währungen im Verhältnis zur Funktionswährung des Teilfonds fällt, oder, im Fall von Absicherungspositionen, dass der Wert der Funktionswährung des Teilfonds im Verhältnis zur abgesicherten Währung fällt. Devisenkurse im Ausland können innerhalb kurzer Zeiträume aus einer Reihe von Gründen erheblich schwanken. Dazu zählen Änderungen der Zinssätze, Interventionen (oder das verpasste Intervenieren) seitens der US- oder ausländischer Regierungen, Zentralbanken oder supranationaler Organisationen wie dem Internationalen Währungsfonds, oder auferlegte Währungskontrollen oder sonstige politische Entwicklungen in oder außerhalb der USA. Im Ergebnis können die Anlagen des Teilfonds in auf ausländische Währungen lautenden Wertpapieren die Erträge des Teilfonds schmälern.

Die Anlagen des PIMCO RAE Fundamental US Fund und des US Small Cap StocksPLUS™ Fund wurden in der Funktionswährung des Teilfonds erworben, so dass kein Fremdwährungsengagement besteht. Die Anlagen des Emerging Markets 2018 Fund, Emerging Markets Corporate Bond Fund, Euro Real Return Fund, Global High Yield Bond Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund und US High Yield Bond Fund hatten zum 31. Dezember 2015 oder 31. Dezember 2014 kein erhebliches Devisenrisiko. Die folgenden Tabellen zeigen das Gesamtengagement im Devisenrisiko in Währungen, bei denen das Fremdwährungsengagement für wesentlich gehalten wird (bei denen unter Konstanthaltung aller anderen Variablen die Auswirkungen einer vernünftigerweise möglichen Entwicklung des Wechselkurses zu einer deutlichen Schwankung des Nettovermögens führen würden) (Angaben in Tausend):

**PIMCO Capital Securities Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 2.035.409 | $ (2.180.198) | $ (144.789) | $ 1.821.985 | $ (1.879.533) | $ (57.548) |

**Commodity Real Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ 45.954 | $ (9.045) | $ 36.909 | $ 241 | $ (764) | $ (523) |
| Euro | 52.394 | (43.389) | 9.005 | 68.625 | (75.303) | (6.678) |
| | $ 98.348 | $ (52.434) | $ 45.914 | $ 68.866 | $ (76.067) | $ (7.201) |

**PIMCO Credit Absolute Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Chinese Renminbi (Offshore) | $ 1 | $ (30.192) | $ (30.191) | $ - | $ - | $ - |
| Euro | 13.054 | (31.566) | (18.512) | 82.545 | (120.072) | (37.527) |
| | $ 13.055 | $ (61.758) | $ (48.703) | $ 82.545 | $ (120.072) | $ (37.527) |

**Diversified Income Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 859.550 | $ (762.669) | $ 96.881 | $ 1.172.274 | $ (1.370.748) | $ (198.474) |
| Japanischer Yen | 53.490 | (113.707) | (60.217) | 70.404 | (336.937) | (266.533) |
| | $ 913.040 | $ (876.376) | $ 36.664 | $ 1.242.678 | $ (1.707.685) | $ (465.007) |

**Diversified Income Duration Hedged Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 164.919 | $ (153.565) | $ 11.354 | $ 277.029 | $ (324.269) | $ (47.240) |
| Japanischer Yen | 13.854 | (24.896) | (11.042) | 17.249 | (80.207) | (62.958) |
| | $ 178.773 | $ (178.461) | $ 312 | $ 294.278 | $ (404.476) | $ (110.198) |

**PIMCO Dividend and Income Builder Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 5.239 | $ - | $ 5.239 | $ 1.270 | $ (139) | $ 1.131 |
| Britisches Pfund Sterling | 13.563 | (8.417) | 5.146 | 18.708 | - | 18.708 |
| Euro | 16.149 | (6.778) | 9.371 | 18.046 | (6.978) | 11.068 |
| Hongkong-Dollar | 3.031 | - | 3.031 | 4.532 | - | 4.532 |
| Schweizer Franken | 3.255 | - | 3.255 | 2.462 | - | 2.462 |
| | $ 41.237 | $ (15.195) | $ 26.042 | $ 45.018 | $ (7.117) | $ 37.901 |

**Emerging Asia Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ (187) | $ 1.915 | $ 1.728 | $ 127 | $ 3.454 | $ 3.581 |
| Chinese Renminbi (Mainland) | - | 5.029 | 5.029 | - | 6.450 | 6.450 |
| Chinese Renminbi (Offshore) | 615 | (2.848) | (2.233) | 650 | 1.662 | 2.312 |
| Tschechische Krone | - | 1.209 | 1.209 | - | 1.932 | 1.932 |
| Hongkong-Dollar | - | 58 | 58 | - | (2.692) | (2.692) |
| Indische Rupie | - | 5.978 | 5.978 | - | 7.073 | 7.073 |
| Indonesische Rupie | - | 2.032 | 2.032 | - | 5.113 | 5.113 |
| Malaysischer Ringgit | 1 | 2.211 | 2.212 | 6.319 | (3.045) | 3.274 |
| Mexikanischer Peso | - | 5.855 | 5.855 | 76 | 8.848 | 8.924 |
| Polnischer Zloty | - | 3.697 | 3.697 | - | 4.632 | 4.632 |
| Russischer Rubel | - | 5.416 | 5.416 | 2.071 | 4.994 | 7.065 |
| Singapur-Dollar | - | 4.070 | 4.070 | - | 7.735 | 7.735 |
| Südafrikanischer Rand | - | 1.937 | 1.937 | - | 2.052 | 2.052 |
| Südkoreanischer Won | - | 5.448 | 5.448 | - | 8.167 | 8.167 |
| Taiwanesischer Dollar | - | 1.945 | 1.945 | - | 4.812 | 4.812 |
| Thailändischer Baht | - | 1.539 | 1.539 | - | 3.559 | 3.559 |
| Türkische Lira | - | 928 | 928 | - | 5.433 | 5.433 |
| | $ 429 | $ 46.419 | $ 46.848 | $ 9.243 | $ 70.179 | $ 79.422 |

**Emerging Local Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 274.812 | $ (64.446) | $ 210.366 | $ 466.541 | $ (39.994) | $ 426.547 |
| Chinese Renminbi (Offshore) | 8.677 | (62.668) | (53.991) | 14.551 | 1.561 | 16.112 |
| Kolumbianischer Peso | 194.257 | (39.518) | 154.739 | 312.927 | 21.457 | 334.384 |
| Indische Rupie | - | 64.824 | 64.824 | - | 7.085 | 7.085 |
| Indonesische Rupie | 166.481 | 76.282 | 242.763 | 357.350 | 43.696 | 401.046 |
| Malaysischer Ringgit | 178.352 | 62.001 | 240.353 | 259.336 | 152.951 | 412.287 |
| Mexikanischer Peso | 182.863 | 142.797 | 325.660 | 200.271 | 315.091 | 515.362 |
| Polnischer Zloty | 188.923 | 176.064 | 364.987 | 367.855 | 145.743 | 513.598 |
| Russischer Rubel | 97.652 | 57.490 | 155.142 | 181.460 | (4.416) | 177.044 |
| Südafrikanischer Rand | 90.648 | 170.056 | 260.704 | 378.192 | 44.658 | 422.850 |
| Taiwanesischer Dollar | - | (73.501) | (73.501) | 1.542 | - | 1.542 |
| Thailändischer Baht | 44.383 | 104.003 | 148.386 | 68.795 | 209.723 | 278.518 |
| Türkische Lira | 159.279 | 57.463 | 216.742 | 291.526 | 238.329 | 529.855 |
| | $ 1.586.327 | $ 670.847 | $ 2.257.174 | $ 2.900.346 | $ 1.135.884 | $ 4.036.230 |

**Emerging Markets Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 132.217 | $ (162.163) | $ (29.946) | $ 162.837 | $ (263.543) | $ (100.706) |

**Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 10.322 | $ (6.610) | $ 3.712 | $ 11.479 | $ (4.682) | $ 6.797 |
| Chinese Renminbi (Mainland) | - | 10.173 | 10.173 | (13) | 9.205 | 9.192 |
| Chinese Renminbi (Offshore) | 2 | (4.227) | (4.225) | 816 | 4.730 | 5.546 |
| Tschechische Krone | 446 | 1.471 | 1.917 | - | 3.747 | 3.747 |
| Indische Rupie | - | 11.033 | 11.033 | - | 14.331 | 14.331 |
| Indonesische Rupie | - | 3.761 | 3.761 | - | 9.030 | 9.030 |
| Malaysischer Ringgit | - | 4.080 | 4.080 | 211 | 5.619 | 5.830 |
| Mexikanischer Peso | 4.764 | 6.337 | 11.101 | 11.166 | 4.337 | 15.503 |
| Polnischer Zloty | 54 | 6.683 | 6.737 | 881 | 7.725 | 8.606 |
| Russischer Rubel | - | 10.325 | 10.325 | 4.577 | 7.826 | 12.403 |
| Singapur-Dollar | - | 7.466 | 7.466 | 4 | 13.580 | 13.584 |
| Südafrikanischer Rand | - | 3.669 | 3.669 | - | 3.590 | 3.590 |
| Südkoreanischer Won | - | 10.383 | 10.383 | - | 17.396 | 17.396 |
| Taiwanesischer Dollar | - | 3.566 | 3.566 | - | 8.514 | 8.514 |
| Thailändischer Baht | - | 2.741 | 2.741 | - | 6.558 | 6.558 |
| Türkische Lira | - | 1.687 | 1.687 | 1.347 | 8.204 | 9.551 |
| | $ 15.588 | $ 72.538 | $ 88.126 | $ 30.468 | $ 119.710 | $ 150.178 |

**PIMCO Emerging Multi-Asset Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Kolumbianischer Peso | $ 5 | $ - | $ 5 | $ 5.898 | $ 3.841 | $ 9.739 |
| Mexikanischer Peso | 1 | - | 1 | 11.640 | 16.088 | 27.728 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | - | 20.999 | 5.983 | 26.982 |
| Südkoreanischer Won | - | - | - | 19.967 | 12.785 | 32.752 |
| | $ 6 | $ - | $ 6 | $ 58.504 | $ 38.697 | $ 97.201 |

**PIMCO EqS Emerging Markets Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ - | $ - | $ - | $ 32.116 | $ (4.016) | $ 28.100 |
| Chinese Renminbi (Mainland) | - | - | - | 19.870 | - | 19.870 |
| Hongkong-Dollar | - | - | - | 134.633 | 1.672 | 136.305 |
| Indische Rupie | - | - | - | 65.497 | (23.842) | 41.655 |
| Indonesische Rupie | - | - | - | 6.880 | 9.247 | 16.127 |
| Malaysischer Ringgit | - | - | - | - | 20.840 | 20.840 |
| Mexikanischer Peso | - | - | - | 12.159 | 16.401 | 28.560 |
| Südafrikanischer Rand | - | - | - | 23.183 | 21.696 | 44.879 |
| Südkoreanischer Won | - | - | - | 51.128 | 48.088 | 99.216 |
| Taiwanesischer Dollar | - | - | - | 38.785 | (4.043) | 34.742 |
| | $ - | $ - | $ - | $ 384.251 | $ 86.043 | $ 470.294 |

**PIMCO EqS Pathfinder Fund™**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ - | $ - | $ - | $ 27.631 | $ (11.974) | $ 15.657 |
| Kanadischer Dollar | - | - | - | 7 | 7.451 | 7.458 |
| Euro | - | - | - | 28.482 | (11.398) | 17.084 |
| Japanischer Yen | - | - | - | 6.047 | 4.370 | 10.417 |
| Schweizer Franken | - | - | - | 7.023 | (328) | 6.695 |
| | $ - | $ - | $ - | $ 69.190 | $ (11.879) | $ 57.311 |

**PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ - | $ - | $ - | € 9.783 | € 2.689 | € 12.472 |
| Dänische Krone | - | - | - | 1.127 | (269) | 858 |
| Schwedische Krone | - | - | - | 1.180 | 619 | 1.799 |
| Schweizer Franken | - | - | - | 3.120 | 2.271 | 5.391 |
| | $ - | $ - | $ - | € 15.210 | € 5.310 | € 20.520 |

**Euro Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Japanischer Yen | € 114.001 | € (118.421) | € (4.420) | € 1.533 | € (31.017) | € (29.484) |
| US-Dollar | 96.140 | (208.145) | (112.005) | 54.107 | (117.778) | (63.671) |
| | € 210.141 | € (326.566) | € (116.425) | € 55.640 | € (148.795) | € (93.155) |

**Euro Credit Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| US-Dollar | € 221.739 | € (207.600) | € 14.139 | € 354.323 | € (337.547) | € 16.776 |

**Euro Income Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| US-Dollar | € 347.675 | € (320.261) | € 27.414 | € 423.102 | € (437.785) | € (14.683) |

**Euro Long Average Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Japanischer Yen | € 420 | € (1.583) | € (1.163) | € 9 | € (18.169) | € (18.160) |
| US-Dollar | 52.616 | (32.771) | 19.845 | 18.066 | (58.188) | (40.122) |
| | € 53.036 | € (34.354) | € 18.682 | € 18.075 | € (76.357) | € 58.282 |

**Euro Low Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| US-Dollar | € 6.370 | € (2.862) | € 3.508 | € 23.302 | € (11.050) | € 12.252 |

**Euro Short-Term Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Dänische Krone | € 38.945 | € (39.130) | € (185) | € 15.291 | € (29.499) | € (14.208) |
| US-Dollar | 22.673 | 3.877 | 26.550 | 24.577 | 24.947 | 49.524 |
| | € 61.618 | € (35.253) | € 26.365 | € 39.868 | € (4.552) | € 35.316 |

**Euro Ultra-Long Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Japanischer Yen | € 1.562 | € (1.696) | € (134) | € - | € (3.494) | € (3.494) |
| Schweizer Franken | 370 | (378) | (8) | 422 | (3.285) | (2.863) |
| US-Dollar | 5.194 | (2.769) | 2.425 | 8.833 | 1.070 | 9.903 |
| | € 7.126 | € (4.843) | € 2.283 | € 9.255 | € (5.709) | € 3.546 |

**Global Advantage Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 132 | $ (7.409) | $ (7.277) | $ 5.071 | $ 11.047 | $ 16.118 |
| Britisches Pfund Sterling | 51.308 | (29.665) | 21.643 | 47.143 | (19.128) | 28.015 |
| Kanadischer Dollar | 19.166 | 6.132 | 25.298 | 6.409 | 13.586 | 19.995 |
| Euro | 257.135 | (10.845) | 246.290 | 269.493 | (78.601) | 190.892 |
| Indische Rupie | - | 17.456 | 17.456 | - | 24.844 | 24.844 |
| Japanischer Yen | 122.393 | (71.637) | 50.756 | 29.641 | 2.105 | 31.746 |
| Mexikanischer Peso | 12.314 | 10.687 | 23.001 | 39.491 | (23.899) | 15.592 |
| Russischer Rubel | - | (525) | (525) | - | 18.466 | 18.466 |
| Südkoreanischer Won | 6.626 | 10.622 | 17.248 | 9.010 | 6.559 | 15.569 |
| | $ 469.074 | $ (75.184) | $ 393.890 | $ 406.258 | $ (45.021) | $ 361.237 |

**Global Advantage Real Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ - | $ 11.910 | $ 11.910 | $ 14.583 | $ 2.110 | $ 16.693 |
| Brasilianischer Real | 10.056 | 27.076 | 37.132 | 142.812 | (54.232) | 88.580 |
| Britisches Pfund Sterling | 69.658 | (5.660) | 63.998 | 42.067 | (11.431) | 30.636 |
| Kanadischer Dollar | 8.735 | 5.392 | 14.127 | 18.043 | 4.103 | 22.146 |
| Chilenischer Peso | 11.248 | 2.769 | 14.017 | 9.730 | 524 | 10.254 |
| Kolumbianischer Peso | 13.274 | 1.206 | 14.480 | 21.484 | (8.861) | 12.623 |
| Euro | 96.036 | 44.492 | 140.528 | 224.610 | (85.904) | 138.706 |
| Israelischer Shekel | 7.358 | 6.677 | 14.035 | (2) | 10.349 | 10.347 |
| Japanischer Yen | 36.007 | (236) | 35.771 | 13.215 | 21.958 | 35.173 |
| Mexikanischer Peso | 71.248 | (27.893) | 43.355 | 55.519 | 3.036 | 58.555 |
| Neuseeländischer Dollar | 9.435 | (19.534) | (10.099) | 17.795 | (16.108) | 1.687 |
| Polnischer Zloty | 56 | - | 56 | 9.967 | 14.026 | 23.993 |
| Südafrikanischer Rand | 21.069 | (3.060) | 18.009 | 14.984 | 129 | 15.113 |
| Südkoreanischer Won | 11.281 | 6.380 | 17.661 | - | 26.437 | 26.437 |
| Türkische Lira | 36.153 | (334) | 35.819 | - | 33.324 | 33.324 |
| | $ 401.614 | $ 49.185 | $ 450.799 | $ 584.807 | $ (60.540) | $ 524.267 |

**Global Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ (4.375) | $ (113.645) | $ (118.020) | $ 413.368 | $ (630.575) | $ (217.207) |
| Britisches Pfund Sterling | 560.418 | (557.171) | 3.247 | 731.959 | (520.484) | 211.475 |
| Euro | 2.843.566 | (1.738.615) | 1.104.951 | 3.193.125 | (2.043.546) | 1.149.579 |
| Japanischer Yen | 982.900 | (1.006.992) | (24.092) | 576.504 | (1.444.159) | (867.655) |
| | $ 4.382.509 | $ (3.416.423) | $ 966.086 | $ 4.914.956 | $ (4.638.764) | $ 276.192 |

**Global Bond Ex-US Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 83 | $ (10.196) | $ (10.113) | $ 20.456 | (36.024) | (15.568) |
| Britisches Pfund Sterling | 59.864 | (61.900) | (2.036) | 64.418 | (45.020) | 19.398 |
| Euro | 292.045 | (183.044) | 109.001 | 353.333 | (219.062) | 134.271 |
| Japanischer Yen | 146.845 | (148.224) | (1.379) | 114.377 | (251.983) | (137.606) |
| | $ 498.837 | $ (403.364) | $ 95.473 | $ 552.584 | $ (552.089) | $ 495 |

**PIMCO Global Dividend Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 2.198 | $ - | $ 2.198 | $ 861 | $ - | $ 861 |
| Brasilianischer Real | 1.460 | (98) | 1.362 | 2.107 | - | 2.107 |
| Britisches Pfund Sterling | 8.176 | (4.590) | 3.586 | 12.382 | - | 12.382 |
| Euro | 9.937 | (3.322) | 6.615 | 12.127 | (12.481) | (354) |
| Hongkong-Dollar | 1.658 | - | 1.658 | 4.396 | - | 4.396 |
| Japanischer Yen | 2.355 | - | 2.355 | 3.582 | (1.871) | 1.711 |
| | $ 25.784 | $ (8.010) | $ 17.774 | $ 35.455 | $ (14.352) | $ 21.103 |

**Global Investment Grade Credit Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 815.660 | $ (1.120.512) | $ (304.852) | $ 833.745 | $ (1.063.635) | $ (229.890) |

**Global Low Duration Real Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ 113.353 | $ (18.550) | $ 94.803 | $ 2.944 | $ (2.918) | $ 26 |
| Euro | 115.083 | (98.325) | 16.758 | 166.361 | (185.096) | (18.735) |
| | $ 228.436 | $ (116.875) | $ 111.561 | $ 169.305 | $ (188.014) | $ (18.709) |

**Global Multi-Asset Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ 84.883 | $ 23.846 | $ 108.729 | $ 8.215 | $ 41.062 | $ 49.277 |
| Kanadischer Dollar | 26 | 34.742 | 34.768 | 4.516 | 20.804 | 25.320 |
| Chinese Renminbi (Mainland) | 47.130 | (1.274) | 45.856 | 26.830 | (20.367) | 6.463 |
| Chinese Renminbi (Offshore) | - | (72.186) | (72.186) | - | - | - |
| Euro | 47.502 | 22.601 | 70.103 | 206.657 | (212.085) | (5.428) |
| Indische Rupie | - | 32.172 | 32.172 | - | 54.134 | 54.134 |
| Japanischer Yen | 11.487 | 61.457 | 72.944 | 4.131 | 18.537 | 22.668 |
| | $ 191.028 | $ 101.358 | $ 292.386 | $ 250.349 | $ (97.915) | $ 152.434 |

**Global Real Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Britisches Pfund Sterling | $ 901.226 | $ (696.567) | $ 204.659 | $ 728.094 | $ (681.535) | $ 46.559 |
| Kanadischer Dollar | 56.121 | (1.392) | 54.729 | 77.372 | (76.504) | 868 |
| Dänische Krone | 61.217 | (120.492) | (59.275) | 82.407 | (103.970) | (21.563) |
| Euro | 495.478 | (319.407) | 176.071 | 829.953 | (886.166) | (56.213) |
| Japanischer Yen | 44.199 | (47.027) | (2.828) | 21.682 | (89.062) | (67.380) |
| | $ 1.558.241 | $ (1.184.885) | $ 373.356 | $ 1.739.508 | $ (1.837.237) | $ (97.729) |

**Income Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 284.288 | $ (576.103) | $ (291.815) | $ 379.379 | $ (381.107) | $ (1.728) |
| Euro | 796.719 | (1.216.544) | (419.825) | 871.636 | (1.145.602) | (273.966) |
| Japanischer Yen | 1.037.091 | (1.208.062) | (170.971) | 42.969 | (297.019) | (254.050) |
| | $ 2.118.098 | $ (3.000.709) | $ (882.611) | $ 1.293.984 | $ (1.823.728) | $ 529.744 |

**Inflation Strategy Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 1.132 | $ 702 | $ 1.834 | $ 8.416 | $ (4.934) | $ 3.482 |
| Euro | 9.356 | (10.009) | (653) | 18.672 | (20.571) | (1.899) |
| Indische Rupie | - | 784 | 784 | - | 1.664 | 1.664 |
| Mexikanischer Peso | 3.897 | (1.650) | 2.247 | 6.507 | (3.736) | 2.771 |
| Türkische Lira | 2.037 | (196) | 1.841 | - | 855 | 855 |
| | $ 16.422 | $ (10.369) | $ 6.053 | $ 33.595 | $ (26.722) | $ 6.873 |

**Low Average Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 60.634 | $ (100.397) | $ (39.763) | $ 303.268 | $ (338.254) | $ (34.986) |

**Low Duration Global Investment Grade Credit Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 10.626 | $ (11.345) | $ (719) | $ 978 | $ (1.164) | $ (186) |

**PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto |
| Brasilianischer Real | $ 549 | $ - | $ 549 |
| Hongkong-Dollar | 2.007 | - | 2.007 |
| Polnischer Zloty | 178 | - | 178 |
| Südafrikanischer Rand | 562 | - | 562 |
| Südkoreanischer Won | 1.001 | - | 1.001 |
| Taiwanesischer Dollar | 481 | - | 481 |
| Thailändischer Baht | 213 | - | 213 |
| | $ 4.991 | $ - | $ 4.991 |

**PIMCO RAE Fundamental Europe Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto |
| Pfund Sterling | € 8.330 | € - | € 8.330 |
| Dänische Krone | 627 | - | 627 |
| Schwedische Krone | 950 | - | 950 |
| Schweizer Franken | 3.237 | - | 3.237 |
| | € 13.144 | € - | € 13.144 |

**PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 217 | $ - | $ 217 |
| Britisches Pfund Sterling | 555 | - | 555 |
| Kanadischer Dollar | 306 | - | 306 |
| Euro | 1.343 | - | 1.343 |
| Japanischer Yen | 705 | - | 705 |
| | $ 3.126 | $ - | $ 3.126 |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 2 | $ - | $ 2 | $ 19 | $ (3.473) | $ (3.454) |
| Kanadischer Dollar | 507 | (497) | 10 | 613 | (2.516) | (1.903) |
| Chinese Renminbi (Offshore) | - | (2.305) | (2.305) | - | - | - |
| Euro | 2.851 | (3.029) | (178) | 17.490 | (20.723) | (3.233) |
| | $ 3.360 | $ (5.831) | $ (2.471) | $ 18.122 | $ (26.712) | $ (8.590) |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 31 | $ 65 | $ 96 | $ 93 | $ (46.883) | $ (46.790) |
| Kanadischer Dollar | 1.014 | (1.287) | (273) | 1.226 | (26.603) | (25.377) |
| Chinese Renminbi (Offshore) | - | (65.803) | (65.803) | - | - | - |
| Euro | 84.354 | (94.689) | (10.335) | 235.092 | (289.027) | (53.935) |
| | $ 85.399 | $ (161.714) | $ (76.315) | $ 236.411 | $ (362.513) | $ (126.102) |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Chinese Renminbi (Offshore) | $ - | $ (6.182) | $ (6.182) | $ - | $ - | $ - |
| Euro | 32.113 | (41.373) | (9.260) | 111.955 | (139.013) | (27.058) |
| Japanischer Yen | 3.562 | (12.443) | (8.881) | 3.629 | (12.904) | (9.275) |
| | $ 36.675 | $ (59.998) | $ (24.323) | $ 115.584 | $ (151.917) | $ (36.333) |

**StocksPLUS™ Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 60.037 | $ (55.182) | $ 4.855 | $ 38.595 | $ (65.265) | $ (26.670) |
| Japanischer Yen | 178.899 | (178.829) | 70 | 67.394 | (94.619) | (27.225) |
| | $ 238.936 | $ (234.011) | $ 4.925 | $ 105.989 | $ (159.884) | $ (53.895) |

**Strategic Income Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 3.683 | $ (1.298) | $ 2.385 | $ 371 | $ (58) | $ 313 |
| Brasilianischer Real | 2.770 | (4.129) | (1.359) | 1.259 | (960) | 299 |
| Britisches Pfund Sterling | 13.115 | (9.696) | 3.419 | 4.535 | (890) | 3.645 |
| Hongkong-Dollar | 1.911 | - | 1.911 | 912 | - | 912 |
| Japanischer Yen | 12.977 | (8.775) | 4.202 | 959 | (1.637) | (678) |
| Singapur-Dollar | 3 | - | 3 | 309 | - | 309 |
| Schweizer Franken | 2.001 | - | 2.001 | 414 | - | 414 |
| Taiwanesischer Dollar | 1.259 | - | 1.259 | 315 | - | 315 |
| Türkische Lira | - | - | - | 237 | - | 237 |
| | $ 37.719 | $ (23.898) | $ 13.821 | $ 9.311 | $ (3.545) | $ 5.766 |

**Total Return Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 306.705 | $ (509.320) | $ (202.615) | $ 1.398.070 | $ (1.993.649) | $ (595.579) |
| Japanischer Yen | 22 | (192.977) | (192.955) | 212.316 | (427.490) | (215.174) |
| | $ 306.727 | $ (702.297) | $ (395.570) | $ 1.610.386 | $ (2.421.139) | $ (810.753) |

**PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 5 | $ (1.993) | $ (1.988) |
| Britisches Pfund Sterling | 30 | (4.747) | (4.717) |
| Kanadischer Dollar | 21 | (3.403) | (3.382) |
| Japanischer Yen | 184 | 2.039 | 2.223 |
| Mexikanischer Peso | - | (1.093) | (1.093) |
| Neuseeländischer Dollar | - | 1.788 | 1.788 |
| Norwegische Krone | - | (1.020) | (1.020) |
| Schwedische Krone | - | 1.977 | 1.977 |
| | $ 240 | $ (6.452) | $ (6.212) |

**UK Corporate Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | £ 41.621 | £ (43.224) | £ (1.603) | £ 32.652 | £ (40.365) | £ (7.713) |
| US-Dollar | 31.317 | (18.148) | 13.169 | 31.729 | (9.987) | 21.742 |
| | £ 72.938 | £ (61.372) | £ 11.566 | £ 64.381 | £ (50.352) | £ 14.029 |

**UK Long Term Corporate Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | £ 47.841 | £ (49.410) | £ (1.569) | £ 55.984 | £ (75.798) | £ (19.814) |
| US-Dollar | 35.450 | (17.451) | 17.999 | 36.850 | 10.038 | 46.888 |
| | £ 83.291 | £ (66.861) | £ 16.430 | £ 92.834 | £ (65.760) | £ 27.074 |

**UK Low Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | £ 10.293 | £ (12.407) | £ (2.114) | £ 24.362 | £ (29.179) | £ (4.817) |
| Japanischer Yen | 7 | - | 7 | 65 | (4.486) | (4.421) |
| US-Dollar | 22.519 | (20.238) | 2.281 | 14.316 | (7.917) | 6.399 |
| | £ 32.819 | £ (32.645) | £ 174 | £ 38.743 | £ (41.582) | £ (2.839) |

**UK Real Return Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | £ 1.138 | £ (1.315) | £ (177) | £ 7.089 | £ (8.522) | £ (1.433) |
| US-Dollar | 1.998 | (1.768) | 230 | 5.701 | (2.983) | 2.718 |
| | £ 3.136 | £ (3.083) | £ 53 | £ 12.790 | £ (11.505) | £ 1.285 |

**UK Sterling Long Average Duration Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | £ 2.267 | £ (2.493) | £ (226) | £ 4.777 | £ (5.447) | £ (670) |
| US-Dollar | 2.636 | (2.442) | 194 | 2.124 | (1.544) | 580 |
| | £ 4.903 | £ (4.935) | £ (32) | £ 6.901 | £ (6.991) | £ (90) |

**Unconstrained Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Australischer Dollar | $ 106 | $ 789 | $ 895 | $ 12.301 | $ (222.410) | $ (210.109) |
| Brasilianischer Real | (15.031) | (56.340) | (71.371) | 563.802 | (543.503) | 20.299 |
| Kanadischer Dollar | 1.582 | (1.592) | (10) | 1.243 | (123.132) | (121.889) |
| Chinese Renminbi (Offshore) | - | (267.448) | (267.448) | - | - | - |
| Euro | 255.783 | (257.910) | (2.127) | 368.764 | (579.779) | (211.015) |
| | $ 242.440 | $ (582.501) | $ (340.061) | $ 946.110 | $ (1.468.824) | $ (522.714) |

| | US Short-Term Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| | Summe | Hedging | Netto | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 2.402 | $ (25.074) | $ (22.672) | $ 2.843 | $ (2.778) | $ 65 |

| | US Small Cap StocksPLUS™ Fund | | |
|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
| | Summe | Hedging | Netto |
| Euro | $ 330 | $ (1.382) | $ (1.052) |

**(c) Zinsrisiko** Das Zinsrisiko ist das Risiko, dass der Wert von Rentenwerten aufgrund veränderter Zinssätze sinkt. Bei einem Anstieg des Nominalzinssatzes sinkt voraussichtlich der Wert bestimmter, von den Teilfonds gehaltener Rentenwerte. Der Nominalzinssatz lässt sich als Summe des realen Zinssatzes und der voraussichtlichen Inflationsrate beschreiben. Rentenwerte mit längeren Laufzeiten reagieren eher empfindlich auf Änderungen der Zinssätze, was sie volatiler macht als Wertpapiere mit kürzeren Laufzeiten. Die Duration dient hauptsächlich als Maß für die Sensitivität des Marktpreises eines Rentenpapiers gegenüber Zinssatzschwankungen (d. h. Renditeschwankungen).

Die Tabellen unten fassen das Zinsrisiko der Teilfonds zusammen (Angaben in Tausend). Sie umfassen die zum Marktwert bewerteten, nicht-derivativen, zinsbringenden Aktiva und Passiva der Teilfonds, geordnet nach Fälligkeitsdatum. Bestimmte im Finanzstatus dargestellte Aktiva und Passiva wurden zum Zweck der Darstellung unten bereinigt.

| | PIMCO Asia Local Bond Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ - | $ - | $ - | $ 687 | $ 3.865 | $ 4.552 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1 | - | 1 | 255 | - | 255 |
| Einlagen bei Kontrahenten | - | - | - | 16 | - | 16 |
| Summe Aktiva | $ 1 | $ - | $ 1 | $ 958 | $ 3.865 | $ 4.823 |

| | PIMCO Capital Securities Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 835.653 | $ 4.303.307 | $ 5.138.960 | $ 145.867 | $ 3.567.385 | $ 3.713.252 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 16.204 | - | 16.204 | 5.351 | - | 5.351 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 51.798 | - | 51.798 | 42.606 | - | 42.606 |
| Summe Aktiva | $ 903.655 | $ 4.303.307 | $ 5.206.962 | $ 193.824 | $ 3.567.385 | $ 3.761.209 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ (560) | $ - | $ (560) | $ - | $ - | $ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (54.964) | - | (54.964) | (38.467) | - | (38.467) |
| Summe Passiva | $ (55.524) | $ - | $ (55.525) | $ (38.467) | $ - | $ (38.467) |

| | Commodity Real Return Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 72.946 | $ 423.918 | $ 496.864 | $ 28.540 | $ 336.661 | $ 365.201 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.727 | - | 1.727 | 1.367 | - | 1.367 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.425 | - | 2.425 | 11.939 | - | 11.939 |
| Summe Aktiva | $ 77.098 | $ 423.918 | $ 501.016 | $ 41.846 | $ 336.661 | $ 378.507 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (3.918) | $ (3.918) | $ - | $ (49.673) | $ (49.673) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.160) | - | (7.160) | (2.355) | - | (2.355) |
| Summe Passiva | $ (7.160) | $ (3.918) | $ (11.078) | $ (2.355) | $ (49.673) | $ (52.028) |

| | PIMCO Credit Absolute Return Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 31.885 | $ 844.262 | $ 876.147 | $ 454.785 | $ 994.740 | $ 1.449.525 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 7.312 | - | 7.312 | 8.888 | - | 8.888 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 15.590 | - | 15.590 | 39.824 | - | 39.824 |
| Summe Aktiva | $ 54.787 | $ 844.262 | $ 899.049 | $ 503.497 | $ 994.740 | $ 1.498.237 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (32.760) | $ - | $ (32.760) | $ (5.620) | $ - | $ (5.620) |
| Summe Passiva | $ (32.760) | $ - | $ (32.760) | $ (5.620) | $ - | $ (5.620) |

| Diversified Income Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 598.396 | $ 5.136.054 | $ 5.734.450 | $ 203.920 | $ 7.379.003 | $ 7.582.923 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 20.816 | - | 20.816 | 24.237 | - | 24.237 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 114.528 | - | 114.528 | 114.457 | - | 114.457 |
| Summe Aktiva | $ 733.740 | $ 5.136.054 | $ 5.869.794 | $ 342.614 | $ 7.379.003 | $ 7.721.617 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (56.220) | $ - | $ (56.220) | $ (77.182) | $ - | $ (77.182) |
| Summe Passiva | $ (56.220) | $ - | $ (56.220) | $ (77.182) | $ - | $ (77.182) |

| Diversified Income Duration Hedged Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 89.184 | $ 929.910 | $ 1.019.094 | $ 117.597 | $ 1.563.406 | $ 1.681.003 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.639 | - | 3.639 | 10.528 | - | 10.528 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 10.305 | - | 10.305 | 5.276 | - | 5.276 |
| Summe Aktiva | $ 103.128 | $ 929.910 | $ 1.033.038 | $ 133.401 | $ 1.563.406 | $ 1.696.807 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (7.100) | $ - | $ (7.100) | $ (24.780) | $ - | $ (24.780) |
| Summe Passiva | $ (7.100) | $ - | $ (7.100) | $ (24.780) | $ - | $ (24.780) |

| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 283 | $ 6.884 | $ 7.167 | $ - | $ 11.943 | $ 11.943 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 752 | - | 752 | 270 | - | 270 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 52 | - | 52 | 2.376 | - | 2.376 |
| Summe Aktiva | $ 1.087 | $ 6.884 | $ 7.971 | $ 2.646 | $ 11.943 | $ 14.589 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (1.036) | $ - | $ (1.036) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.690) | - | (1.690) | (1.560) | - | (1.560) |
| Summe Passiva | $ (1.690) | $ - | $ (1.690) | $ (2.596) | $ - | $ (2.596) |

| Emerging Asia Bond Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 899 | $ 48.117 | $ 49.016 | $ 768 | $ 78.865 | $ 79.633 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 616 | - | 616 | 7.162 | - | 7.162 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 648 | - | 648 | 3.191 | - | 3.191 |
| Summe Aktiva | $ 2.163 | $ 48.117 | $ 50.280 | $ 11.121 | $ 78.865 | $ 89.986 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (220) | $ - | $ (220) | $ - | $ - | $ - |
| Summe Passiva | $ (220) | $ - | $ (220) | $ - | $ - | $ - |

| Emerging Local Bond Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 414.786 | $ 1.923.635 | $ 2.338.421 | $ 381.318 | $ 3.608.735 | $ 3.990.053 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 12.375 | - | 12.375 | 24.214 | - | 24.214 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 48.820 | - | 48.820 | 79.602 | - | 79.602 |
| Summe Aktiva | $ 475.981 | $ 1.923.635 | $ 2.399.616 | $ 485.134 | $ 3.608.735 | $ 4.093.869 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (82.767) | $ - | $ (82.767) | $ (17.219) | $ - | $ (17.219) |
| Summe Passiva | $ (82.767) | $ - | $ (82.767) | $ (17.219) | $ - | $ (17.219) |

| Emerging Markets 2018 Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 1.400 | $ 49.839 | $ 51.239 | $ 800 | $ 28.656 | $ 29.456 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 966 | - | 966 | 893 | - | 893 |
| Summe Aktiva | $ 2.366 | $ 49.839 | $ 52.205 | $ 1.693 | $ 28.656 | $ 30.349 |

| Emerging Markets Bond Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 74.869 | $ 2.692.192 | $ 2.767.061 | $ 25.717 | $ 4.417.863 | $ 4.443.580 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 14.923 | - | 14.923 | 5.324 | - | 5.324 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 40.328 | - | 40.328 | 98.936 | - | 98.936 |
| Summe Aktiva | $ 130.120 | $ 2.692.192 | $ 2.822.312 | $ 129.977 | $ 4.417.863 | $ 4.547.840 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (1.092) | $ (1.092) | $ - | $ (1.104) | $ (1.104) |
| Einlagen von Kontrahenten | (62.430) | - | (62.430) | (2.772) | - | (2.772) |
| Summe Passiva | $ (62.430) | $ (1.092) | $ (63.522) | $ (2.772) | $ (1.104) | $ (3.876) |

| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 5.483 | $ 565.486 | $ 570.969 | $ 51.902 | $ 958.168 | $ 1.010.070 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 2.781 | - | 2.781 | 1.136 | - | 1.136 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.851 | - | 2.851 | 18.370 | - | 18.370 |
| Summe Aktiva | $ 11.115 | $ 565.486 | $ 576.601 | $ 71.408 | $ 958.168 | $ 1.029.576 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (7.170) | $ - | $ (7.170) | $ (1.419) | $ - | $ (1.419) |
| Summe Passiva | $ (7.170) | $ - | $ (7.170) | $ (1.419) | $ - | $ (1.419) |

| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 60.671 | $ 33.015 | $ 93.686 | $ 86.719 | $ 60.907 | $ 147.626 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 726 | - | 726 | 672 | - | 672 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.413 | - | 1.413 | 3.741 | - | 3.741 |
| Summe Aktiva | $ 62.810 | $ 33.015 | $ 95.825 | $ 91.132 | $ 60.907 | $ 152.039 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (5.570) | $ - | $ (5.570) | $ (287) | $ - | $ (287) |
| Summe Passiva | $ (5.570) | $ - | $ (5.570) | $ (287) | $ - | $ (287) |

| PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ - | $ - | $ - | $ 10.004 | $ 199.333 | $ 209.337 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 36 | - | 36 | 6.813 | - | 6.813 |
| Einlagen bei Kontrahenten | - | - | - | 3.969 | - | 3.969 |
| Summe Aktiva | $ 36 | $ - | $ 36 | $ 20.786 | $ 199.333 | $ 220.119 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ - | $ - | $ - | $ (3.450) | $ - | $ (3.450) |
| Summe Passiva | $ - | $ - | $ - | $ (3.450) | $ - | $ (3.450) |

| PIMCO EqS Emerging Markets Fund | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ - | $ - | $ - | $ 44 | $ - | $ 44 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 39 | - | 39 | 6.301 | - | 6.301 |
| Einlagen bei Kontrahenten | - | - | - | 4.647 | - | 4.647 |
| Summe Aktiva | $ 39 | $ - | $ 39 | $ 10.992 | $ - | $ 10.992 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (1.164) | $ - | $ (1.164) |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | (3.560) | - | (3.560) |
| Summe Passiva | $ - | $ - | $ - | $ (4.724) | $ - | $ (4.724) |

| PIMCO EqS Pathfinder Fund™ | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | $ 53 | $ - | $ 53 | $ 400 | $ - | $ 400 |
| Einlagen bei Kontrahenten | - | - | - | 1.210 | - | 1.210 |
| Summe Aktiva | $ 53 | $ - | $ 53 | $ 1.610 | $ - | $ 1.610 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (3) | $ - | $ (3) |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | (1.250) | - | (1.250) |
| Summe Passiva | $ - | $ - | $ - | $ (1.253) | $ - | $ (1.253) |

## PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € - | € - | € - | € 3.902 | € - | € 3.902 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 2 | - | 2 | 47 | - | 47 |
| Summe Aktiva | € 2 | € - | € 2 | € 3.949 | € - | € 3.949 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € - | € - | € - | € (260) | € - | € (260) |
| Summe Passiva | € - | € - | € - | € (260) | € - | € (260) |

## Euro Bond Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 258.073 | € 859.081 | € 1.117.154 | € 199.507 | € 800.391 | € 999.898 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 6.433 | - | 6.433 | 7.079 | - | 7.079 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 8.296 | - | 8.296 | 7.594 | - | 7.594 |
| Summe Aktiva | € 272.802 | € 859.081 | € 1.131.883 | € 214.180 | € 800.391 | € 1.014.571 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | € - | € (64.033) | € (64.033) | € - | € - | € - |
| Einlagen von Kontrahenten | (15.025) | - | (15.025) | (2.359) | - | (2.359) |
| Summe Passiva | € (15.025) | € (64.033) | € (79.058) | € (2.359) | € - | € (2.359) |

## Euro Credit Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 28.922 | € 389.486 | € 418.408 | € 54.736 | € 707.410 | € 762.146 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 18.465 | - | 18.465 | 7.837 | - | 7.837 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.403 | - | 5.403 | 13.154 | - | 13.154 |
| Summe Aktiva | € 52.790 | € 389.486 | € 442.276 | € 75.727 | € 707.410 | € 783.137 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € (6.371) | € - | € (6.371) | € (425) | € - | € (425) |
| Summe Passiva | € (6.371) | € - | € (6.371) | € (425) | € - | € (425) |

## Euro Income Bond Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 33.874 | € 720.879 | € 754.753 | € 98.914 | € 899.092 | € 998.006 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 41.163 | - | 41.163 | 7.063 | - | 7.063 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 12.026 | - | 12.026 | 13.879 | - | 13.879 |
| Summe Aktiva | € 87.063 | € 720.879 | € 807.942 | € 119.856 | € 899.092 | € 1.018.948 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € (14.912) | € - | € (14.912) | € (2.925) | € - | € (2.925) |
| Summe Passiva | € (14.912) | € - | € (14.912) | € (2.925) | € - | € (2.925) |

## Euro Long Average Duration Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 18.439 | € 497.698 | € 516.137 | € 84.945 | € 538.341 | € 623.286 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.883 | - | 3.883 | 2.580 | - | 2.580 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 4.724 | - | 4.724 | 1.388 | - | 1.388 |
| Summe Aktiva | € 27.046 | € 497.698 | € 524.744 | € 88.913 | € 538.341 | € 627.254 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € (1.828) | € - | € (1.828) | € (1.104) | € - | € (1.104) |
| Summe Passiva | € (1.828) | € - | € (1.828) | € (1.104) | € - | € (1.104) |

## Euro Low Duration Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 10.343 | € 53.693 | € 64.036 | € 38.607 | € 181.658 | € 220.265 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 680 | - | 680 | 196 | - | 196 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 506 | - | 506 | 137 | - | 137 |
| Summe Aktiva | € 11.529 | € 53.693 | € 65.222 | € 38.940 | € 181.658 | € 220.598 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € (672) | € - | € (672) | € (281) | € - | € (281) |
| Summe Passiva | € (672) | € - | € (672) | € (281) | € - | € (281) |

## Euro Real Return Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € - | € 28.050 | € 28.050 | € 566 | € 26.140 | € 26.706 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 573 | - | 573 | 390 | - | 390 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 91 | - | 91 | 140 | - | 140 |
| Summe Aktiva | € 664 | € 28.050 | € 28.714 | € 1.096 | € 26.140 | € 27.236 |

## Euro Short-Term Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 353.512 | € 452.067 | € 805.579 | € 247.002 | € 330.615 | € 577.617 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 30.944 | - | 30.944 | 286 | - | 286 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 699 | - | 699 | 1.310 | - | 1.310 |
| Summe Aktiva | € 385.155 | € 452.067 | € 837.222 | € 248.598 | € 330.615 | € 579.213 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | € (1.830) | € - | € (1.830) | € (260) | € - | € (260) |
| Summe Passiva | € (1.830) | € - | € (1.830) | € (260) | € - | € (260) |

## Euro Ultra-Long Duration Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | € 6.759 | € 36.369 | € 43.128 | € 27.676 | € 67.271 | € 94.947 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 739 | - | 739 | 3.100 | - | 3.100 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 3.471 | - | 3.471 | 4.077 | - | 4.077 |
| Summe Aktiva | € 10.969 | € 36.369 | € 47.338 | € 34.853 | € 67.271 | € 102.124 |

## Global Advantage Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 200.977 | $ 573.801 | $ 774.778 | $ 67.578 | $ 548.911 | $ 616.489 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 4.686 | - | 4.686 | 3.301 | - | 3.301 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 6.607 | - | 6.607 | 16.106 | - | 16.106 |
| Summe Aktiva | $ 212.270 | $ 573.801 | $ 786.071 | $ 86.985 | $ 548.911 | $ 635.896 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (12.796) | $ (12.796) | $ - | $ - | $ - |
| Überziehungskredit | - | - | - | (14) | - | (14) |
| Einlagen von Kontrahenten | (14.735) | - | (14.735) | (3.681) | - | (3.681) |
| Summe Passiva | $ (14.735) | $ (12.796) | $ (27.531) | $ (3.695) | $ - | $ (3.695) |

## Global Advantage Real Return Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 19.483 | $ 674.687 | $ 694.170 | $ 12.649 | $ 883.900 | $ 896.549 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 5.390 | - | 5.390 | 4.220 | - | 4.220 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.817 | - | 2.817 | 8.354 | - | 8.354 |
| Summe Aktiva | $ 27.690 | $ 674.687 | $ 702.377 | $ 25.223 | $ 883.900 | $ 909.123 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (11.438) | $ (11.438) |
| Überziehungskredit | - | - | - | (2) | - | (2) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.480) | - | (7.480) | (5.387) | - | (5.387) |
| Summe Passiva | $ (7.480) | $ - | $ (7.480) | $ (5.389) | $ (11.438) | $ (16.827) |

## Global Bond Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 1.545.562 | $ 7.140.487 | $ 8.686.049 | $ 620.006 | $ 7.932.715 | $ 8.552.721 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 44.244 | - | 44.244 | 25.601 | - | 25.601 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 76.280 | - | 76.280 | 47.787 | - | 47.787 |
| Summe Aktiva | $ 1.666.086 | $ 7.140.487 | $ 8.806.573 | $ 693.394 | $ 7.932.715 | $ 8.626.109 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (462.963) | $ (462.963) | $ - | $ (755.903) | $ (755.903) |
| Überziehungskredit | - | - | - | (1) | - | (1) |
| Einlagen von Kontrahenten | (222.689) | - | (222.689) | (210.695) | - | (210.695) |
| Summe Passiva | $ (222.689) | $ (462.963) | $ (685.652) | $ (210.696) | $ (755.903) | $ (966.599) |

## Global Bond Ex-US Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 126.689 | $ 606.987 | $ 733.676 | $ 46.632 | $ 708.337 | $ 754.969 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 5.210 | - | 5.210 | 3.429 | - | 3.429 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 12.288 | - | 12.288 | 5.249 | - | 5.249 |
| Summe Aktiva | $ 144.187 | $ 606.987 | $ 751.174 | $ 55.310 | $ 708.337 | $ 763.647 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (45.058) | $ (45.058) | $ - | $ (55.850) | $ (55.850) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.467) | - | (7.467) | (16.056) | - | (16.056) |
| Summe Passiva | $ (7.467) | $ (45.058) | $ (52.525) | $ (16.056) | $ (55.850) | $ (71.906) |

## PIMCO Global Dividend Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | $ 673 | $ - | $ 673 | $ 1.724 | $ - | $ 1.724 |
| Einlagen bei Kontrahenten | - | - | - | 530 | - | 530 |
| Summe Aktiva | $ 673 | $ - | $ 673 | $ 2.254 | $ - | $ 2.254 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (650) | $ - | $ (650) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.020) | - | (1.020) | (520) | - | (520) |
| Summe Passiva | $ (1.020) | $ - | $ (1.020) | $ (1.170) | $ - | $ (1.170) |

## Global High Yield Bond Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 4.959 | $ 3.433.114 | $ 3.438.073 | $ 10.411 | $ 3.590.471 | $ 3.600.882 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.638 | - | 3.638 | 4.971 | - | 4.971 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 34.130 | - | 34.130 | 26.426 | - | 26.426 |
| Summe Aktiva | $ 42.727 | $ 3.433.114 | $ 3.475.841 | $ 41.808 | $ 3.590.471 | $ 3.632.279 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (36) | $ - | $ (36) |
| Einlagen von Kontrahenten | (27.360) | - | (27.360) | (3.630) | - | (3.630) |
| Summe Passiva | $ (27.360) | $ - | $ (27.360) | $ (3.666) | $ - | $ (3.666) |

## Global Investment Grade Credit Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 883.824 | $ 14.031.378 | $ 14.915.202 | $ 743.327 | $ 10.459.285 | $ 11.202.612 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 14.986 | - | 14.986 | 30.297 | - | 30.297 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 84.518 | - | 84.518 | 204.574 | - | 204.574 |
| Summe Aktiva | $ 983.328 | $ 14.031.378 | $ 15.014.706 | $ 978.198 | $ 10.459.285 | $ 11.437.483 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (75.396) | $ (75.396) | $ - | $ (69.652) | $ (69.652) |
| Einlagen von Kontrahenten | (102.532) | - | (102.532) | (70.492) | - | (70.492) |
| Summe Passiva | $ (102.532) | $ (75.396) | $ (177.928) | $ (70.492) | $ (69.652) | $ (140.144) |

## Global Low Duration Real Return Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 48.594 | $ 686.585 | $ 735.179 | $ 173.709 | $ 518.933 | $ 692.642 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.851 | - | 1.851 | 1.159 | - | 1.159 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.776 | - | 5.776 | 11.296 | - | 11.296 |
| Summe Aktiva | $ 56.221 | $ 686.585 | $ 742.806 | $ 186.164 | $ 518.933 | $ 705.097 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (4.170) | $ (4.170) |
| Einlagen von Kontrahenten | (13.860) | - | (13.860) | (4.500) | - | (4.500) |
| Summe Passiva | $ (13.860) | $ - | $ (13.860) | $ (4.500) | $ (4.170) | $ (8.670) |

## Global Multi-Asset Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 72.334 | $ 627.167 | $ 699.501 | $ 108.771 | $ 585.221 | $ 693.992 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 62.464 | - | 62.464 | 12.899 | - | 12.899 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.005 | - | 5.005 | 18.555 | - | 18.555 |
| Summe Aktiva | $ 139.803 | $ 627.167 | $ 766.970 | $ 140.225 | $ 585.221 | $ 725.446 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (127.958) | $ (127.958) |
| Einlagen von Kontrahenten | (30.680) | - | (30.680) | (8.519) | - | (8.519) |
| Summe Passiva | $ (30.680) | $ - | $ (30.680) | $ (8.519) | $ (127.958) | $ (136.477) |

## Global Real Return Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 140.073 | $ 3.255.287 | $ 3.395.360 | $ 80.889 | $ 3.343.452 | $ 3.424.341 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 6.560 | - | 6.560 | 8.934 | - | 8.934 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 11.812 | - | 11.812 | 37.366 | - | 37.366 |
| Summe Aktiva | $ 158.445 | $ 3.255.287 | $ 3.413.732 | $ 127.189 | $ 3.343.452 | $ 3.470.641 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (108.191) | $ (108.191) |
| Einlagen von Kontrahenten | (45.545) | - | (45.545) | (21.704) | - | (21.704) |
| Summe Passiva | $ (45.545) | $ - | $ (45.545) | $ (21.704) | $ (108.191) | $ (129.895) |

## Income Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 1.638.233 | $ 10.036.542 | $ 11.674.775 | $ 634.985 | $ 7.170.957 | $ 7.805.942 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 50.633 | - | 50.633 | 32.281 | - | 32.281 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 66.788 | - | 66.788 | 83.598 | - | 83.598 |
| Summe Aktiva | $ 1.755.654 | $ 10.036.542 | $ 11.792.196 | $ 750.864 | $ 7.170.957 | $ 7.921.821 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (516.279) | $ (516.279) | $ - | $ - | $ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (57.440) | - | (57.440) | (19.068) | - | (19.068) |
| Summe Passiva | $ (57.440) | $ (516.279) | $ (573.719) | $ (19.068) | $ - | $ (19.068) |

## Inflation Strategy Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 1.833 | $ 59.874 | $ 61.707 | $ 10.280 | $ 69.087 | $ 79.367 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.202 | - | 1.202 | 677 | - | 677 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.383 | - | 1.383 | 768 | - | 768 |
| Summe Aktiva | $ 4.418 | $ 59.874 | $ 64.292 | $ 11.725 | $ 69.087 | $ 80.812 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (5.213) | $ (5.213) |
| Einlagen von Kontrahenten | (2.750) | - | (2.750) | (1.000) | - | (1.000) |
| Summe Passiva | $ (2.750) | $ - | $ (2.750) | $ (1.000) | $ (5.213) | $ (6.213) |

## Low Average Duration Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 271.657 | $ 1.595.411 | $ 1.867.068 | $ 124.135 | $ 1.734.582 | $ 1.858.717 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 10.615 | - | 10.615 | 2.602 | - | 2.602 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 3.462 | - | 3.462 | 10.046 | - | 10.046 |
| Summe Aktiva | $ 285.734 | $ 1.595.411 | $ 1.881.145 | $ 136.783 | $ 1.734.582 | $ 1.871.365 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (2.230) | $ (2.230) | $ - | $ (2.238) | $ (2.238) |
| Einlagen von Kontrahenten | (51.400) | - | (51.400) | (22.830) | - | (22.830) |
| Summe Passiva | $ (51.400) | $ (2.230) | $ (53.630) | $ (22.830) | $ (2.238) | $ (25.068) |

**Low Duration Global Investment Grade Credit Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 14.919 | $ 79.707 | $ 94.626 | $ 925 | $ 7.607 | $ 8.532 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 581 | - | 581 | 150 | - | 150 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 401 | - | 401 | 45 | - | 45 |
| Summe Aktiva | $ 15.901 | $ 79.707 | $ 95.608 | $ 1.120 | $ 7.607 | $ 8.727 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (10) | $ - | $ (10) | $ - | $ - | $ - |
| Summe Passiva | $ (10) | $ - | $ (10) | $ - | $ - | $ - |

**PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 52.892 | $ 4.384 | $ 57.276 | $ 50.294 | $ 12.092 | $ 62.386 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 684 | - | 684 | 742 | - | 742 |
| Summe Aktiva | $ 53.576 | $ 4.384 | $ 57.960 | $ 51.036 | $ 12.092 | $ 63.128 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (6.250) | $ - | $ (6.250) | $ (3.450) | $ - | $ (3.450) |
| Summe Passiva | $ (6.250) | $ - | $ (6.250) | $ (3.450) | $ - | $ (3.450) |

**PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | $ 32 | $ - | $ 32 |
| Summe Aktiva | $ 32 | $ - | $ 32 |

**PIMCO RAE Fundamental Europe Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | € 224 | € - | € 224 |
| Summe Aktiva | € 224 | € - | € 224 |

**PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | $ 85 | $ - | $ 85 |
| Summe Aktiva | $ 85 | $ - | $ 85 |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 4.616 | $ 26.832 | $ 31.448 | $ 25.761 | $ 74.330 | $ 100.091 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 215 | - | 215 | 1.103 | - | 1.103 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.282 | - | 2.282 | 6.156 | - | 6.156 |
| Summe Aktiva | $ 7.113 | $ 26.832 | $ 33.945 | $ 33.020 | $ 74.330 | $ 107.350 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (3.606) | $ (3.606) | $ - | $ (12.442) | $ (12.442) |
| Überziehungskredit | - | - | - | (27) | - | (27) |
| Einlagen von Kontrahenten | (890) | - | (890) | (1.080) | - | (1.080) |
| Summe Passiva | $ (890) | $ (3.606) | $ (4.496) | $ (1.107) | $ (12.442) | $ (13.549) |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 84.455 | $ 808.981 | $ 893.436 | $ 140.638 | $ 959.810 | $ 1.100.448 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.003 | - | 3.003 | 4.904 | - | 4.904 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 17.585 | - | 17.585 | 24.531 | - | 24.531 |
| Summe Aktiva | $ 105.043 | $ 808.981 | $ 914.024 | $ 170.073 | $ 959.810 | $ 1.129.883 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (82.933) | $ (82.933) | $ - | $ (168.650) | $ (168.650) |
| Einlagen von Kontrahenten | (18.870) | - | (18.870) | (9.160) | - | (9.160) |
| Summe Passiva | $ (18.870) | $ (82.933) | $ (101.803) | $ (9.160) | $ (168.650) | $ (177.810) |

**PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 56.363 | $ 267.345 | $ 323.708 | $ 146.624 | $ 304.947 | $ 451.571 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 2.770 | - | 2.770 | 1.484 | - | 1.484 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.281 | - | 1.281 | 5.064 | - | 5.064 |
| Summe Aktiva | $ 60.414 | $ 267.345 | $ 327.759 | $ 153.172 | $ 304.947 | $ 458.119 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (23.838) | $ (23.838) |
| Einlagen von Kontrahenten | (11.035) | - | (11.035) | (17.438) | - | (17.438) |
| Summe Passiva | $ (11.035) | $ - | $ (11.035) | $ (17.438) | $ (23.838) | $ (41.276) |

**PIMCO RAE Fundamental US Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | $ 52 | $ - | $ 52 |
| Summe Aktiva | $ 52 | $ - | $ 52 |

**Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 17.984 | $ 247.279 | $ 265.263 | $ 946 | $ 307.797 | $ 308.743 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 927 | - | 927 | 734 | - | 734 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.256 | - | 2.256 | 4.877 | - | 4.877 |
| Summe Aktiva | $ 21.167 | $ 247.279 | $ 268.446 | $ 6.557 | $ 307.797 | $ 314.354 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (3.820) | $ - | $ (3.820) | $ (55) | $ - | $ (55) |
| Summe Passiva | $ (3.820) | $ - | $ (3.820) | $ (55) | $ - | $ (55) |

**StocksPLUS™ Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 361.290 | $ 1.055.520 | $ 1.416.810 | $ 717.726 | $ 437.568 | $ 1.155.294 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 5.812 | - | 5.812 | 2.344 | - | 2.344 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.708 | - | 5.708 | 37.698 | - | 37.698 |
| Summe Aktiva | $ 372.810 | $ 1.055.520 | $ 1.428.330 | $ 757.768 | $ 437.568 | $ 1.195.336 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (79.603) | $ (79.603) | $ - | $ - | $ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (15.670) | - | (15.670) | (13.311) | - | (13.311) |
| Summe Passiva | $ (15.670) | $ (79.603) | $ (95.273) | $ (13.311) | $ - | $ (13.311) |

**Strategic Income Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 28.917 | $ 94.219 | $ 123.136 | $ 13.240 | $ 28.130 | $ 41.370 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 2.811 | - | 2.811 | 690 | - | 690 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.987 | - | 2.987 | 353 | - | 353 |
| Summe Aktiva | $ 34.715 | $ 94.219 | $ 128.934 | $ 14.283 | $ 28.130 | $ 42.413 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (3.309) | $ (3.309) | $ - | $ - | $ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (3.240) | - | (3.240) | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (3.240) | $ (3.309) | $ (6.549) | $ - | $ - | $ - |

**Total Return Bond Fund**

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 230.642 | $ 9.142.131 | $ 9.372.773 | $ 370.843 | $ 10.889.683 | $ 11.260.526 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 11.732 | - | 11.732 | 19.720 | - | 19.720 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 23.380 | - | 23.380 | 101.986 | - | 101.986 |
| Summe Aktiva | $ 265.754 | $ 9.142.131 | $ 9.407.885 | $ 492.549 | $ 10.889.683 | $ 11.382.232 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | $ - | $ - | $ - | $ (4) | $ - | $ (4) |
| Einlagen von Kontrahenten | (272.077) | - | (272.077) | (127.715) | - | (127.715) |
| Summe Passiva | $ (272.077) | $ - | $ (272.077) | $ (127.719) | $ - | $ (127.719) |

## PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

| Aktiva | Zum 31. Dez. 2015 Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 9.382 | $ 13.139 | $ 22.521 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 473 | - | 473 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 1.212 | - | 1.212 |
| Summe Aktiva | $ 11.067 | $ 13.139 | $ 24.206 |

## UK Corporate Bond Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | £ 4.105 | £ 250.475 | £ 254.580 | £ 2.699 | £ 299.283 | £ 301.982 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 855 | - | 855 | 1.848 | - | 1.848 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.134 | - | 2.134 | 878 | - | 878 |
| Summe Aktiva | £ 7.094 | £ 250.475 | £ 257.569 | £ 5.425 | £ 299.283 | £ 304.708 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | £ (5.611) | £ - | £ (5.611) | £ - | £ - | £ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (97) | - | (97) | (1.675) | - | (1.675) |
| Summe Passiva | £ (5.708) | £ - | £ (5.708) | £ (1.675) | £ - | £ (1.675) |

## UK Long Term Corporate Bond Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | £ 1.607 | £ 579.039 | £ 580.646 | £ 85.447 | £ 763.289 | £ 848.736 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.448 | - | 1.448 | 9.288 | - | 9.288 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.705 | - | 5.705 | 10.812 | - | 10.812 |
| Summe Aktiva | £ 8.760 | £ 579.039 | £ 587.799 | £ 105.547 | £ 763.289 | £ 868.836 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Überziehungskredit | £ (13.065) | £ - | £ (13.065) | £ - | £ - | £ - |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.133) | - | (1.133) | (3.842) | - | (3.842) |
| Summe Passiva | £ (14.198) | £ - | £ (14.198) | £ (3.842) | £ - | £ (3.842) |

## UK Low Duration Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | £ 12.772 | £ 154.778 | £ 167.550 | £ 16.840 | £ 157.666 | £ 174.506 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 7.483 | - | 7.483 | 5.541 | - | 5.541 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 2.316 | - | 2.316 | 359 | - | 359 |
| Summe Aktiva | £ 22.571 | £ 154.778 | £ 177.349 | £ 22.740 | £ 157.666 | £ 180.406 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | £ (680) | £ - | £ (680) | £ (600) | £ - | £ (600) |
| Summe Passiva | £ (680) | £ - | £ (680) | £ (600) | £ - | £ (600) |

## UK Real Return Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | £ 2.383 | £ 22.194 | £ 24.577 | £ 616 | £ 64.611 | £ 65.227 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 247 | - | 247 | 3.086 | - | 3.086 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 302 | - | 302 | 601 | - | 601 |
| Summe Aktiva | £ 2.932 | £ 22.194 | £ 25.126 | £ 4.303 | £ 64.611 | £ 68.914 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | £ (60) | £ - | £ (60) | £ (1.012) | £ - | £ (1.012) |
| Summe Passiva | £ (60) | £ - | £ (60) | £ (1.012) | £ - | £ (1.012) |

## UK Sterling Long Average Duration Fund

| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | £ 783 | £ 22.652 | £ 23.435 | £ 78 | £ 31.953 | £ 32.031 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 235 | - | 235 | 2.824 | - | 2.824 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 184 | - | 184 | 105 | - | 105 |
| Summe Aktiva | £ 1.202 | £ 22.652 | £ 23.854 | £ 3.007 | £ 31.953 | £ 34.960 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | £ (250) | £ - | £ (250) | £ (367) | £ - | £ (367) |
| Summe Passiva | £ (250) | £ - | £ (250) | £ (367) | £ - | £ (367) |

| | Unconstrained Bond Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 248.553 | $ 3.431.691 | $ 3.680.244 | $ 908.010 | $ 4.327.164 | $ 5.235.174 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 7.114 | - | 7.114 | 17.966 | - | 17.966 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 41.230 | - | 41.230 | 62.049 | - | 62.049 |
| Summe Aktiva | $ 296.897 | $ 3.431.691 | $ 3.728.588 | $ 988.025 | $ 4.327.164 | $ 5.315.189 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (393.933) | $ (393.933) | $ - | $ (1.103.025) | $ (1.103.025) |
| Einlagen von Kontrahenten | (303.200) | - | (303.200) | (225.022) | - | (225.022) |
| Summe Passiva | $ (303.200) | $ (393.933) | $ (697.133) | $ (225.022) | $ (1.103.025) | $ (1.328.047) |

| | US High Yield Bond Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 1.317 | $ 1.798.127 | $ 1.799.444 | $ 3.992 | $ 1.617.899 | $ 1.621.891 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 2.695 | - | 2.695 | 4.308 | - | 4.308 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 10.606 | - | 10.606 | 13.116 | - | 13.116 |
| Summe Aktiva | $ 14.618 | $ 1.798.127 | $ 1.812.745 | $ 21.416 | $ 1.617.899 | $ 1.639.315 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (12.280) | $ - | $ (12.280) | $ (580) | $ - | $ (580) |
| Summe Passiva | $ (12.280) | $ - | $ (12.280) | $ (580) | $ - | $ (580) |

| | US Short-Term Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | Zum 31. Dez. 2014 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 167.906 | $ 500.525 | $ 668.431 | $ 133.369 | $ 287.791 | $ 421.160 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 3.975 | - | 3.975 | 543 | - | 543 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 899 | - | 899 | 1.970 | - | 1.970 |
| Summe Aktiva | $ 172.780 | $ 500.525 | $ 673.305 | $ 135.882 | $ 287.791 | $ 423.673 |
| **Passiva** | | | | | | |
| Einlagen von Kontrahenten | $ (380) | $ - | $ (380) | $ - | $ - | $ - |
| Summe Passiva | $ (380) | $ - | $ (380) | $ - | $ - | $ - |

| | US Small Cap StocksPLUS™ Fund | | |
|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | |
| **Aktiva** | Weniger als 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Übertragbare Wertpapiere und Einlagen bei Kreditinstituten | $ 15.572 | $ 59.220 | $ 74.792 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.633 | - | 1.633 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 653 | - | 653 |
| Summe Aktiva | $ 17.858 | $ 59.220 | $ 77.078 |
| **Passiva** | | | |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | $ - | $ (3.523) | $ (3.523) |
| Einlagen von Kontrahenten | (10) | - | (10) |
| Summe Passiva | $ (10) | $ (3.523) | $ (3.533) |

**(d) Liquiditätsrisiko** Das Liquiditätsrisiko des Teilfonds wird hauptsächlich durch die Rücknahme von Anteilen beeinflusst, die Anleger eventuell zu verkaufen beabsichtigen. Gewinnberechtigte Anteilinhaber können jederzeit ohne Vorankündigung einige oder alle ihre umlaufenden Anteile zurückgeben. Rückgabeberechtigte Anteile werden auf Ansuchen des Anteilinhabers zurückgenommen und im Finanzstatus ausgewiesen. Die Vermögenswerte des Teilfonds bestehen hauptsächlich aus jederzeit veräußerbaren Wertpapieren, die umgehend verkauft werden können, um Rücknahmen von Anteilinhabern in Übereinstimmung mit dem Prospekt ausführen zu können. Ein Liquiditätsrisiko liegt vor, wenn sich bestimmte Anlagen schwer kaufen oder verkaufen lassen. Die Anlagen eines Teilfonds in illiquiden Wertpapieren können die Erträge des Teilfonds schmälern, da dieser eventuell nicht in der Lage ist, die illiquiden Wertpapiere zu einer günstigen Zeit oder einem günstigen Kurs zu veräußern. Teilfonds mit Kapitalanlagestrategien, die Devisen, Derivate oder Wertpapiere mit beträchtlichen Markt- und/oder Kreditrisiken enthalten, neigen dazu, am anfälligsten für Liquiditätsrisiken zu sein.

Kurzfristige Verbindlichkeiten derivativer Finanzinstrumente bestehen aus dem Marktwert von Terminkontrakten, Optionskontrakten, Swaps sowie Devisenterminkontrakten zum Ende des Berichtszeitraums. Das Anlagen- und Vermögenswertportfolio enthält den Abrechnungsmonat und die vertraglichen Beträge aus den Devisenterminkontrakten. Derivative Finanzinstrumente sind Finanzvermögen und -verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten und hauptsächlich zum kurzfristigen Verkauf erworben werden. Da nicht davon auszugehen ist, dass die Instrumente bis zur Fälligkeit oder Beendigung gehalten werden, stellt der aktuelle Marktwert den geschätzten Kapitalfluss dar, der erforderlich sein kann, um die Positionen zu veräußern. Zukünftige Kapitalflüsse der Teilfonds und realisierte Verbindlichkeiten können von den kurzfristigen Verbindlichkeiten aufgrund veränderter Marktbedingungen abweichen.

Die Anlageberatungsgesellschaften verwalten das Liquiditätsrisiko, indem sie die Portfolios überwachen und Anlagen prüfen, die als illiquide oder nicht jederzeit und sofort verkäuflich gelten, um sicherzustellen, dass ausreichend liquide Vermögenswerte vorhanden sind, um die ausstehenden Verbindlichkeiten der Teilfonds zu begleichen. Die folgenden Tabellen fassen die derzeit bekannten Verbindlichkeiten des Teilfonds zusammen (ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber) und gliedern sie nach den zu erwartenden Zahlungsdaten für diese Verbindlichkeiten (Angaben in Tausend): unter drei Monaten, drei Monate bis zu einem Jahr, über ein Jahr. Die zu erwartenden Zahlungsdaten repräsentieren möglicherweise nicht den tatsächlichen Mittelabfluss, da Anleger in diese Instrumente sie üblicherweise mittel- bis langfristig halten.

**PIMCO Asia Local Bond Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (43) | $ - | $ - | $ (43) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | - | - | - | - | (8) | - | - | (8) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Summe Passiva | $ (1) | $ - | $ - | $ (1) | $ (53) | $ - | $ - | $ (53) |

**PIMCO Capital Securities Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (69.059) | $ - | $ - | $ (69.059) | $ (34.058) | $ - | $ - | $ (34.058) |
| Zinsverbindlichkeiten | (195) | - | - | (195) | (86) | - | - | (86) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (13.550) | - | - | (13.550) | (11.907) | - | - | (11.907) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (5.206) | - | - | (5.206) | (2.223) | - | - | (2.223) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (5.436) | - | - | (5.436) | (4.069) | - | - | (4.069) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (57.697) | - | - | (57.697) | (76.518) | - | - | (76.518) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (290) | - | - | (290) | (117) | - | - | (117) |
| Überziehungskredit | (560) | - | - | (560) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (54.964) | - | - | (54.964) | (38.467) | - | - | (38.467) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (34.223) | - | - | (34.223) | (95.258) | - | - | (95.258) |
| Summe Passiva | $ (241.180) | $ - | $ - | $ (241.180) | $ (262.703) | $ - | $ - | $ (262.703) |

**Commodity Real Return Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (4.467) | $ (561) | $ - | $ (5.028) | $ (19.259) | $ (32) | $ (409) | $ (19.700) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (3.918) | (3.918) | - | - | (49.673) | (49.673) |
| Zinsverbindlichkeiten | (35) | - | - | (35) | (64) | - | - | (64) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (3.593) | - | - | (3.593) | (164) | - | - | (164) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (11.520) | - | - | (11.520) | (94.260) | - | - | (94.260) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (452) | - | - | (452) | (145) | - | - | (145) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (285) | - | - | (285) | (280) | - | - | (280) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (61.520) | - | - | (61.520) | (33.740) | - | - | (33.740) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (81.855) | - | - | (81.855) | (23.028) | - | - | (23.028) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (238) | - | - | (238) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.160) | - | - | (7.160) | (2.355) | - | - | (2.355) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (726) | - | - | (726) | (2.469) | - | - | (2.469) |
| Summe Passiva | $ (171.852) | $ (561) | $ (3.918) | $ (176.331) | $ (175.764) | $ (32) | $ (50.082) | $ (225.878) |

**PIMCO Credit Absolute Return Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (24.983) | $ - | $ - | $ (24.983) | $ (35.599) | $ (37) | $ - | $ (35.636) |
| Zinsverbindlichkeiten | (73) | - | - | (73) | (31) | - | - | (31) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (9.817) | - | - | (9.817) | (9.096) | - | - | (9.096) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (740) | - | - | (740) | (1.573) | - | - | (1.573) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.184) | - | - | (1.184) | (1.830) | - | - | (1.830) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | - | - | - | - | (5.229) | - | - | (5.229) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (7) | - | - | (7) | (9) | - | - | (9) |
| Einlagen von Kontrahenten | (32.760) | - | - | (32.760) | (5.620) | - | - | (5.620) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (8.547) | - | - | (8.547) | (56.997) | - | - | (56.997) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (22) | - | - | (22) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (78.133) | $ - | $ - | $ (78.133) | $ (115.984) | $ (37) | $ - | $ (116.021) |

| Diversified Income Fund | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| Passiva | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (161.329) | $ (31) | $ - | $ (161.360) | $ (127.329) | $ - | $ - | $ (127.329) |
| Zinsverbindlichkeiten | (126) | - | - | (126) | (288) | - | - | (288) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (21.028) | - | - | (21.028) | (28.881) | - | - | (28.881) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (8.718) | - | - | (8.718) | (8.651) | - | - | (8.651) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (5.219) | - | - | (5.219) | (958) | - | - | (958) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (180.760) | - | - | (180.760) | (929.435) | - | - | (929.435) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (45) | - | - | (45) | (116) | - | - | (116) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (21.540) | - | - | (21.540) |
| Einlagen von Kontrahenten | (56.220) | - | - | (56.220) | (77.182) | - | - | (77.182) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (76.076) | - | - | (76.076) | (176.136) | - | - | (176.136) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (210) | - | - | (210) | (308) | - | - | (308) |
| Summe Passiva | $ (509.731) | $ (31) | $ - | $ (509.762) | $ (1.370.824) | $ - | $ - | $ (1.370.824) |

| Diversified Income Duration Hedged Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| Passiva | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (31.127) | $ - | $ - | $ (31.127) | $ (50.422) | $ - | $ - | $ (50.422) |
| Zinsverbindlichkeiten | (14) | - | - | (14) | (66) | - | - | (66) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.765) | - | - | (1.765) | (4.854) | - | - | (4.854) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (440) | - | - | (440) | (635) | - | - | (635) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (819) | - | - | (819) | (1.599) | - | - | (1.599) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (21.741) | - | - | (21.741) | (135.079) | - | - | (135.079) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (118) | - | - | (118) | (3) | - | - | (3) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.100) | - | - | (7.100) | (24.780) | - | - | (24.780) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (18.674) | - | - | (18.674) | (47.014) | - | - | (47.014) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (81.799) | $ - | $ - | $ (81.799) | $ (264.452) | $ - | $ - | $ (264.452) |

| PIMCO Dividend and Income Builder Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| Passiva | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (223) | $ - | $ - | $ (223) | $ (95) | $ - | $ - | $ (95) |
| Zinsverbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.224) | - | - | (1.224) | (7) | - | - | (7) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (314) | - | - | (314) | (181) | - | - | (181) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (237) | - | - | (237) | (262) | - | - | (262) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (3) | - | - | (3) | (2) | - | - | (2) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (1.036) | - | - | (1.036) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (7) | - | - | (7) | (39) | - | - | (39) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.690) | - | - | (1.690) | (1.560) | - | - | (1.560) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (805) | - | - | (805) | (5.007) | - | - | (5.007) |
| Summe Passiva | $ (4.504) | $ - | $ - | $ (4.504) | $ (8.190) | $ - | $ - | $ (8.190) |

| Emerging Asia Bond Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| Passiva | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (1.594) | $ (117) | $ - | $ (1.711) | $ (4.686) | $ (150) | $ - | $ (4.836) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | - | - | - | - | (1.060) | - | - | (1.060) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (77) | - | - | (77) | (143) | - | - | (143) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (58) | - | - | (58) | (123) | - | - | (123) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (2.060) | - | - | (2.060) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | - | - | - | - | (981) | - | - | (981) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (50) | - | - | (50) |
| Einlagen von Kontrahenten | (220) | - | - | (220) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (1.949) | $ (117) | $ - | $ (2.066) | $ (9.103) | $ (150) | $ - | $ (9.253) |

## Emerging Local Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (131.287) | $ (14.975) | $ - | $ (146.262) | $ (174.176) | $ (4.143) | $ (317) | $ (178.636) |
| Zinsverbindlichkeiten | (119) | - | - | (119) | (57) | - | - | (57) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (6.473) | - | - | (6.473) | (9.613) | - | - | (9.613) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (657) | - | - | (657) | (18.617) | - | - | (18.617) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (2.453) | - | - | (2.453) | (4.408) | - | - | (4.408) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (402) | - | - | (402) | (2.351) | - | - | (2.351) |
| Einlagen von Kontrahenten | (82.767) | - | - | (82.767) | (17.219) | - | - | (17.219) |
| Summe Passiva | $ (224.158) | $ (14.975) | $ - | $ (239.133) | $ (226.441) | $ (4.143) | $ (317) | $ (230.901) |

## Emerging Markets 2018 Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (143) | $ - | $ - | $ (143) | $ (36) | $ - | $ - | $ (36) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (875) | - | - | (875) | (608) | - | - | (608) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (17) | - | - | (17) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (22) | - | - | (22) | (10) | - | - | (10) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (2.343) | - | - | (2.343) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (28) | - | - | (28) | (28) | - | - | (28) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (119) | - | - | (119) | (94) | - | - | (94) |
| Summe Passiva | $ (3.547) | $ - | $ - | $ (3.547) | $ (776) | $ - | $ - | $ (776) |

## Emerging Markets Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (72.066) | $ (27) | $ - | $ (72.093) | $ (76.530) | $ (131) | $ - | $ (76.661) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (1.092) | (1.092) | - | - | (1.104) | (1.104) |
| Zinsverbindlichkeiten | (112) | - | - | (112) | (64) | - | - | (64) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (14.054) | - | - | (14.054) | (5.976) | - | - | (5.976) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1.091) | - | - | (1.091) | (5.891) | - | - | (5.891) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (3.198) | - | - | (3.198) | (4.402) | - | - | (4.402) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (36.976) | - | - | (36.976) | (30.028) | - | - | (30.028) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (9) | - | - | (9) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (1.143) | - | - | (1.143) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (62.430) | - | - | (62.430) | (2.772) | - | - | (2.772) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (18.790) | - | - | (18.790) | (96.277) | - | - | (96.277) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (5.917) | - | - | (5.917) | (6.581) | - | - | (6.581) |
| Summe Passiva | $ (215.786) | $ (27) | $ (1.092) | $ (216.905) | $ (228.521) | $ (131) | $ (1.104) | $ (229.756) |

## Emerging Markets Corporate Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (2.631) | $ - | $ - | $ (2.631) | $ (10.607) | $ - | $ - | $ (10.607) |
| Zinsverbindlichkeiten | (7) | - | - | (7) | (11) | - | - | (11) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (814) | - | - | (814) | (1.107) | - | - | (1.107) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (130) | - | - | (130) | (1.006) | - | - | (1.006) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (470) | - | - | (470) | (1.118) | - | - | (1.118) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (15.818) | - | - | (15.818) | (2.741) | - | - | (2.741) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.170) | - | - | (7.170) | (1.419) | - | - | (1.419) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (2.473) | - | - | (2.473) | (20.678) | - | - | (20.678) |
| Summe Passiva | $ (29.514) | $ - | $ - | $ (29.514) | $ (38.687) | $ - | $ - | $ (38.687) |

## Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (4.202) | $ (337) | $ (1) | $ (4.540) | $ (7.726) | $ (289) | $ (62) | $ (8.077) |
| Zinsverbindlichkeiten | (2) | - | - | (2) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (270) | - | - | (270) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (21) | - | - | (21) | (24) | - | - | (24) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (85) | - | - | (85) | (142) | - | - | (142) |
| Einlagen von Kontrahenten | (5.570) | - | - | (5.570) | (287) | - | - | (287) |
| Summe Passiva | $ (10.150) | $ (337) | $ (1) | $ (10.488) | $ (8.180) | $ (289) | $ (62) | $ (8.531) |

**PIMCO Emerging Multi-Asset Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (7.856) | $ (170) | $ - | $ (8.026) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | - | - | - | - | (311) | - | - | (311) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (36) | - | - | (36) | (8) | - | - | (8) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | - | - | - | - | (48) | - | - | (48) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (16.151) | - | - | (16.151) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | - | - | - | - | (18) | - | - | (18) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (419) | - | - | (419) |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | - | (3.450) | - | - | (3.450) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | - | - | - | - | (192) | - | - | (192) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | - | - | - | - | (18) | - | - | (18) |
| Summe Passiva | $ (36) | $ - | $ - | $ (36) | $ (28.473) | $ (170) | $ - | $ (28.643) |

**PIMCO EqS Emerging Markets Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (12.239) | $ (299) | $ - | $ (12.538) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (39) | - | - | (39) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | - | - | - | - | (753) | - | - | (753) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | - | - | - | - | (1.308) | - | - | (1.308) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (1.164) | - | - | (1.164) |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | - | (3.560) | - | - | (3.560) |
| Summe Passiva | $ (39) | $ - | $ - | $ (39) | $ (19.025) | $ (299) | $ - | $ (19.324) |

**PIMCO EqS Pathfinder Fund™**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ - | $ - | $ - | $ - | $ (1.344) | $ - | $ - | $ (1.344) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | - | - | - | - | (231) | - | - | (231) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (47) | - | - | (47) | (75) | - | - | (75) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (6) | - | - | (6) | (6) | - | - | (6) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (3) | - | - | (3) |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | - | (1.250) | - | - | (1.250) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | - | - | - | - | (3.457) | - | - | (3.457) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | - | - | - | - | (8) | - | - | (8) |
| Summe Passiva | $ (53) | $ - | $ - | $ (53) | $ (6.376) | $ - | $ - | $ (6.376) |

**PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € - | € - | € - | € - | € (353) | € - | € - | € (353) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (2) | - | - | (2) | (5) | - | - | (5) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | - | - | - | - | (83) | - | - | (83) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | - | - | - | - | (260) | - | - | (260) |
| Summe Passiva | € (3) | € - | € - | € (3) | € (701) | € - | € - | € (701) |

**Euro Bond Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (18.701) | € (829) | € - | € (19.530) | € (30.661) | € (89) | € - | € (30.750) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (64.033) | (64.033) | - | - | - | - |
| Zinsverbindlichkeiten | (21) | - | - | (21) | (4) | - | - | (4) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (11.126) | - | - | (11.126) | (3.268) | - | - | (3.268) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (102.139) | - | - | (102.139) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (895) | - | - | (895) | (1.990) | - | - | (1.990) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (543) | - | - | (543) | (554) | - | - | (554) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (48.118) | - | - | (48.118) | (20.000) | - | - | (20.000) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (6.550) | - | - | (6.550) |
| Einlagen von Kontrahenten | (15.025) | - | - | (15.025) | (2.359) | - | - | (2.359) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (194) | - | - | (194) | (44) | - | - | (44) |
| Summe Passiva | € (196.762) | € (829) | € (64.033) | € (261.624) | € (65.430) | € (89) | € - | € (65.519) |

## Euro Credit Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (3.700) | € - | € - | € (3.700) | € (20.773) | € - | € - | € (20.773) |
| Zinsverbindlichkeiten | (9) | - | - | (9) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (9.699) | - | - | (9.699) | (887) | - | - | (887) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (225) | - | - | (225) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (274) | - | - | (274) | (599) | - | - | (599) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (38.975) | - | - | (38.975) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (11.188) | - | - | (11.188) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (2.842) | - | - | (2.842) |
| Einlagen von Kontrahenten | (6.371) | - | - | (6.371) | (425) | - | - | (425) |
| Summe Passiva | € (31.466) | € - | € - | € (31.466) | € (64.502) | € - | € - | € (64.502) |

## Euro Income Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (9.976) | € - | € - | € (9.976) | € (28.495) | € - | € - | € (28.495) |
| Zinsverbindlichkeiten | (42) | - | - | (42) | (3) | - | - | (3) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (16.563) | - | - | (16.563) | (1.710) | - | - | (1.710) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1.599) | - | - | (1.599) | (2.717) | - | - | (2.717) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (743) | - | - | (743) | (972) | - | - | (972) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (60.660) | - | - | (60.660) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (25.911) | - | - | (25.911) | (7.313) | - | - | (7.313) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (13) | - | - | (13) | (6) | - | - | (6) |
| Einlagen von Kontrahenten | (14.912) | - | - | (14.912) | (2.925) | - | - | (2.925) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | € (69.760) | € - | € - | € (69.760) | € (104.801) | € - | € - | € (104.801) |

## Euro Long Average Duration Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (8.130) | € (231) | € - | € (8.361) | € (13.749) | € (56) | € - | € (13.805) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (3) | - | - | (3) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.804) | - | - | (1.804) | (1.285) | - | - | (1.285) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (3) | - | - | (3) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (163) | - | - | (163) | (247) | - | - | (247) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (2.723) | - | - | (2.723) | (11.684) | - | - | (11.684) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (9.751) | - | - | (9.751) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.828) | - | - | (1.828) | (1.104) | - | - | (1.104) |
| Summe Passiva | € (14.651) | € (231) | € - | € (14.882) | € (37.823) | € (56) | € - | € (37.879) |

## Euro Low Duration Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (810) | € (116) | € - | € (926) | € (1.831) | € - | € - | € (1.831) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (2) | - | - | (2) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (16) | - | - | (16) | (24) | - | - | (24) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (48) | - | - | (48) | (142) | - | - | (142) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (4.004) | - | - | (4.004) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (13) | - | - | (13) | (61) | - | - | (61) |
| Einlagen von Kontrahenten | (672) | - | - | (672) | (281) | - | - | (281) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (95) | - | - | (95) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | € (5.660) | € (116) | € - | € (5.776) | € (2.340) | € - | € - | € (2.340) |

## Euro Real Return Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (406) | € - | € - | € (406) | € (648) | € - | € - | € (648) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (11) | - | - | (11) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (25) | - | - | (25) | (57) | - | - | (57) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (417) | - | - | (417) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (7) | - | - | (7) |
| Summe Passiva | € (859) | € - | € - | € (859) | € (712) | € - | € - | € (712) |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

**Euro Short-Term Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (1.534) | € (7) | € - | € (1.541) | € (2.236) | € - | € - | € (2.236) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (65.411) | - | - | (65.411) | (1.373) | - | - | (1.373) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1.756) | - | - | (1.756) | (96) | - | - | (96) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (285) | - | - | (285) | (316) | - | - | (316) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (6.764) | - | - | (6.764) | (8.218) | - | - | (8.218) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.830) | - | - | (1.830) | (260) | - | - | (260) |
| Summe Passiva | € (77.580) | € (7) | € - | € (77.587) | € (12.499) | € - | € - | € (12.499) |

**Euro Ultra-Long Duration Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | € (2.123) | € (30) | € - | € (2.153) | € (2.030) | € - | € - | € (2.030) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (163) | - | - | (163) | (1.561) | - | - | (1.561) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (40) | - | - | (40) | (69) | - | - | (69) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (21.292) | - | - | (21.292) |
| Summe Passiva | € (2.326) | € (30) | € - | € (2.356) | € (24.952) | € - | € - | € (24.952) |

**Global Advantage Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (20.177) | $ (1.070) | $ - | $ (21.247) | $ (24.231) | $ (494) | $ - | $ (24.725) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (12.796) | (12.796) | - | - | - | - |
| Zinsverbindlichkeiten | (19) | - | - | (19) | (7) | - | - | (7) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.850) | - | - | (1.850) | (3.274) | - | - | (3.274) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (52.559) | - | - | (52.559) | (8.660) | - | - | (8.660) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (80) | - | - | (80) | (44) | - | - | (44) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (260) | - | - | (260) | (147) | - | - | (147) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (10.199) | - | - | (10.199) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (29.102) | - | - | (29.102) | (723) | - | - | (723) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (10) | - | - | (10) | (9) | - | - | (9) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (14) | - | - | (14) |
| Einlagen von Kontrahenten | (14.735) | - | - | (14.735) | (3.681) | - | - | (3.681) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (8.418) | - | - | (8.418) | (16.494) | - | - | (16.494) |
| Summe Passiva | $ (137.409) | $ (1.070) | $ (12.796) | $ (151.275) | $ (57.284) | $ (494) | $ - | $ (57.778) |

**Global Advantage Real Return Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (9.469) | $ (17) | $ - | $ (9.486) | $ (18.199) | $ (123) | $ - | $ (18.322) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (11.438) | (11.438) |
| Zinsverbindlichkeiten | (4) | - | - | (4) | (285) | - | - | (285) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (14.881) | - | - | (14.881) | (983) | - | - | (983) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | - | - | - | - | (19.935) | - | - | (19.935) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (174) | - | - | (174) | (162) | - | - | (162) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (290) | - | - | (290) | (243) | - | - | (243) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (49.397) | - | - | (49.397) | (232.471) | - | - | (232.471) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (242.458) | - | - | (242.458) | (39.357) | - | - | (39.357) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (75) | - | - | (75) | (99) | - | - | (99) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.480) | - | - | (7.480) | (5.387) | - | - | (5.387) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (3.311) | - | - | (3.311) | (7.045) | - | - | (7.045) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | - | - | - | - | (4) | - | - | (4) |
| Summe Passiva | $ (327.539) | $ (17) | $ - | $ (327.556) | $ (324.172) | $ (123) | $ (11.438) | $ (335.733) |

## Global Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (211.584) | $ (4.890) | $ - | $ (216.474) | $ (232.247) | $ (2.597) | $ - | $ (234.844) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (462.963) | (462.963) | - | - | (755.903) | (755.903) |
| Zinsverbindlichkeiten | (197) | - | - | (197) | (607) | - | - | (607) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (29.101) | - | - | (29.101) | (68.310) | - | - | (68.310) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (1.565.925) | - | - | (1.565.925) | (819.872) | - | - | (819.872) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (2.362) | - | - | (2.362) | (3.960) | - | - | (3.960) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (3.842) | - | - | (3.842) | (3.215) | - | - | (3.215) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (2.010) | - | - | (2.010) | (829.155) | - | - | (829.155) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (132.852) | - | - | (132.852) | (68.445) | - | - | (68.445) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (278) | - | - | (278) | (24) | - | - | (24) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (1) | - | - | (1) |
| Einlagen von Kontrahenten | (222.689) | - | - | (222.689) | (210.695) | - | - | (210.695) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (57.865) | - | - | (57.865) | (125.037) | - | - | (125.037) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | (6) | - | - | (6) |
| Summe Passiva | $ (2.228.706) | $ (4.890) | $ (462.963) | $ (2.696.559) | $ (2.361.574) | $ (2.597) | $ (755.903) | $ (3.120.074) |

## Global Bond Ex-US Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (19.450) | $ (574) | $ - | $ (20.024) | $ (22.145) | $ (192) | $ - | $ (22.337) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (45.058) | (45.058) | - | - | (55.850) | (55.850) |
| Zinsverbindlichkeiten | (12) | - | - | (12) | (750) | - | - | (750) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (4.762) | - | - | (4.762) | (4.584) | - | - | (4.584) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (79.693) | - | - | (79.693) | (44.290) | - | - | (44.290) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (5.462) | - | - | (5.462) | (237) | - | - | (237) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (462) | - | - | (462) | (394) | - | - | (394) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (20.183) | - | - | (20.183) | (102.975) | - | - | (102.975) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | - | - | - | - | (1.141) | - | - | (1.141) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (56) | - | - | (56) | (43) | - | - | (43) |
| Einlagen von Kontrahenten | (7.467) | - | - | (7.467) | (16.056) | - | - | (16.056) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (262) | - | - | (262) | (578) | - | - | (578) |
| Summe Passiva | $ (137.809) | $ (574) | $ (45.058) | $ (183.441) | $ (193.193) | $ (192) | $ (55.850) | $ (249.235) |

## PIMCO Global Dividend Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (274) | $ - | $ - | $ (274) | $ (158) | $ - | $ - | $ (158) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (899) | - | - | (899) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (79) | - | - | (79) | (201) | - | - | (201) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (33) | - | - | (33) | (4) | - | - | (4) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (650) | - | - | (650) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.020) | - | - | (1.020) | (520) | - | - | (520) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (695) | - | - | (695) | (2.453) | - | - | (2.453) |
| Summe Passiva | $ (3.000) | $ - | $ - | $ (3.000) | $ (3.986) | $ - | $ - | $ (3.986) |

## Global High Yield Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (17.228) | $ - | $ - | $ (17.228) | $ (6.537) | $ - | $ - | $ (6.537) |
| Zinsverbindlichkeiten | (72) | - | - | (72) | (18) | - | - | (18) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (22.575) | - | - | (22.575) | (4.854) | - | - | (4.854) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (3.203) | - | - | (3.203) | (5.208) | - | - | (5.208) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (2.427) | - | - | (2.427) | (2.656) | - | - | (2.656) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | - | - | - | - | (75.318) | - | - | (75.318) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (392) | - | - | (392) | (298) | - | - | (298) |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (36) | - | - | (36) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (464) | - | - | (464) |
| Einlagen von Kontrahenten | (27.360) | - | - | (27.360) | (3.630) | - | - | (3.630) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (43.279) | - | - | (43.279) | (54.872) | - | - | (54.872) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (35) | - | - | (35) | (34) | - | - | (34) |
| Summe Passiva | $ (116.571) | $ - | $ - | $ (116.571) | $ (153.925) | $ - | $ - | $ (153.925) |

| | Global Investment Grade Credit Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (232.459) | $ (3.876) | $ (3.244) | $ (239.579) | $ (206.482) | $ (4.092) | $ (2.191) | $ (212.765) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (75.396) | (75.396) | - | - | (69.652) | (69.652) |
| Zinsverbindlichkeiten | (387) | - | - | (387) | (122) | - | - | (122) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (88.275) | - | - | (88.275) | (24.242) | - | - | (24.242) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (88.435) | - | - | (88.435) | (79.827) | - | - | (79.827) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (10.608) | - | - | (10.608) | (5.205) | - | - | (5.205) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (6.728) | - | - | (6.728) | (4.216) | - | - | (4.216) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (120.010) | - | - | (120.010) | (68.825) | - | - | (68.825) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (2.965.338) | - | - | (2.965.338) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (577) | - | - | (577) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (30.302) | - | - | (30.302) |
| Einlagen von Kontrahenten | (102.532) | - | - | (102.532) | (70.492) | - | - | (70.492) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (138.193) | - | - | (138.193) | (223.792) | - | - | (223.792) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (3) | - | - | (3) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (3.753.545) | $ (3.876) | $ (78.640) | $ (3.836.061) | $ (713.506) | $ (4.092) | $ (71.843) | $ (789.441) |

| | Global Low Duration Real Return Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (11.471) | $ - | $ - | $ (11.471) | $ (11.371) | $ (8) | $ - | $ (11.379) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (4.170) | (4.170) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (553) | - | - | (553) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (29.891) | - | - | (29.891) | (621) | - | - | (621) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | - | - | - | - | (4.252) | - | - | (4.252) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (432) | - | - | (432) | (77) | - | - | (77) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (422) | - | - | (422) | (438) | - | - | (438) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (72.913) | - | - | (72.913) | (161.590) | - | - | (161.590) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (123.513) | - | - | (123.513) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (13) | - | - | (13) | (13) | - | - | (13) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (46) | - | - | (46) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (13.860) | - | - | (13.860) | (4.500) | - | - | (4.500) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (5.014) | - | - | (5.014) | (15.773) | - | - | (15.773) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Summe Passiva | $ (257.575) | $ - | $ - | $ (257.575) | $ (199.190) | $ (8) | $ (4.170) | $ (203.368) |

| | Global Multi-Asset Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (18.492) | $ (128) | $ - | $ (18.620) | $ (40.692) | $ (130) | $ - | $ (40.822) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (127.958) | (127.958) |
| Zinsverbindlichkeiten | (40) | - | - | (40) | (12) | - | - | (12) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (9.052) | - | - | (9.052) | (19.764) | - | - | (19.764) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (215.120) | - | - | (215.120) | (239.736) | - | - | (239.736) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (1.242) | - | - | (1.242) | (523) | - | - | (523) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.524) | - | - | (1.524) | (1.399) | - | - | (1.399) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (21.715) | - | - | (21.715) | (63.025) | - | - | (63.025) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (85.485) | - | - | (85.485) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (7.008) | - | - | (7.008) | (4.391) | - | - | (4.391) |
| Einlagen von Kontrahenten | (30.680) | - | - | (30.680) | (8.519) | - | - | (8.519) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (8.435) | - | - | (8.435) | (19.694) | - | - | (19.694) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | (18) | - | - | (18) |
| Summe Passiva | $ (398.794) | $ (128) | $ - | $ (398.922) | $ (397.773) | $ (130) | $ (127.958) | $ (525.861) |

| | Global Real Return Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (63.597) | $ - | $ - | $ (63.597) | $ (58.454) | $ (12) | $ - | $ (58.466) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (108.191) | (108.191) |
| Zinsverbindlichkeiten | (85) | - | - | (85) | (604) | - | - | (604) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (5.966) | - | - | (5.966) | (4.698) | - | - | (4.698) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | - | - | - | - | (186.145) | - | - | (186.145) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (2.608) | - | - | (2.608) | (5.094) | - | - | (5.094) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.836) | - | - | (1.836) | (1.691) | - | - | (1.691) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (504.392) | - | - | (504.392) | (716.382) | - | - | (716.382) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (543.251) | - | - | (543.251) | (490.094) | - | - | (490.094) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (80) | - | - | (80) | (77) | - | - | (77) |
| Einlagen von Kontrahenten | (45.545) | - | - | (45.545) | (21.704) | - | - | (21.704) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (20.165) | - | - | (20.165) | (38.330) | - | - | (38.330) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (1.187.526) | $ - | $ - | $ (1.187.526) | $ (1.523.273) | $ (12) | $ (108.191) | $ (1.631.476) |

| | Income Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (230.019) | $ (541) | $ - | $ (230.560) | $ (114.982) | $ (259) | $ - | $ (115.241) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (516.279) | (516.279) | - | - | - | - |
| Zinsverbindlichkeiten | (281) | - | - | (281) | (93) | - | - | (93) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (383.018) | - | - | (383.018) | (28.755) | - | - | (28.755) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (486.575) | - | - | (486.575) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (10.451) | - | - | (10.451) | (2.093) | - | - | (2.093) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (10.836) | - | - | (10.836) | (7.239) | - | - | (7.239) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (16.305) | - | - | (16.305) | (14.474) | - | - | (14.474) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (681) | - | - | (681) | (112) | - | - | (112) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (74.022) | - | - | (74.022) | (43.450) | - | - | (43.450) |
| Einlagen von Kontrahenten | (57.440) | - | - | (57.440) | (19.068) | - | - | (19.068) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (44.324) | - | - | (44.324) | (119.043) | - | - | (119.043) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (1.313.953) | $ (541) | $ (516.279) | $ (1.830.773) | $ (349.309) | $ (259) | $ - | $ (349.568) |

| | Inflation Strategy Fund | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (1.508) | $ (14) | $ - | $ (1.522) | $ (2.211) | $ (5) | $ - | $ (2.216) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (5.213) | (5.213) |
| Zinsverbindlichkeiten | - | - | - | - | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (765) | - | - | (765) | (163) | - | - | (163) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | - | - | - | - | (2.126) | - | - | (2.126) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (12) | - | - | (12) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (78) | - | - | (78) | (79) | - | - | (79) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (671) | - | - | (671) | (15.626) | - | - | (15.626) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (16.958) | - | - | (16.958) | (2.685) | - | - | (2.685) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (15) | - | - | (15) | (15) | - | - | (15) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (130) | - | - | (130) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (2.750) | - | - | (2.750) | (1.000) | - | - | (1.000) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (302) | - | - | (302) | (352) | - | - | (352) |
| Summe Passiva | $ (23.189) | $ (14) | $ - | $ (23.203) | $ (24.258) | $ (5) | $ (5.213) | $ (29.476) |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

## Low Average Duration Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (10.979) | $ (1.633) | $ - | $ (12.612) | $ (22.180) | $ (4.210) | $ (762) | $ (27.152) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (2.230) | (2.230) | - | - | (2.238) | (2.238) |
| Zinsverbindlichkeiten | (41) | - | - | (41) | (35) | - | - | (35) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.061) | - | - | (1.061) | (1.492) | - | - | (1.492) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (405.027) | - | - | (405.027) | (5.650) | - | - | (5.650) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (757) | - | - | (757) | (9.258) | - | - | (9.258) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (877) | - | - | (877) | (981) | - | - | (981) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (17.205) | - | - | (17.205) | (38.305) | - | - | (38.305) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (195.043) | - | - | (195.043) | (2.708) | - | - | (2.708) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (250) | - | - | (250) | (179) | - | - | (179) |
| Einlagen von Kontrahenten | (51.400) | - | - | (51.400) | (22.830) | - | - | (22.830) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (6.018) | - | - | (6.018) | (16.787) | - | - | (16.787) |
| Summe Passiva | $ (688.658) | $ (1.633) | $ (2.230) | $ (692.521) | $ (120.405) | $ (4.210) | $ (3.000) | $ (127.615) |

## Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (370) | $ - | $ - | $ (370) | $ (73) | $ - | $ - | $ (73) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (61.057) | - | - | (61.057) | (106) | - | - | (106) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (28) | - | - | (28) | (6) | - | - | (6) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (576) | - | - | (576) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (16.625) | - | - | (16.625) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (12) | - | - | (12) | (11) | - | - | (11) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (25) | - | - | (25) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (10) | - | - | (10) | - | - | - | - |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (464) | - | - | (464) | (220) | - | - | (220) |
| Summe Passiva | $ (78.591) | $ - | $ - | $ (78.591) | $ (992) | $ - | $ - | $ (992) |

## PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (91) | $ - | $ - | $ (91) | $ (6) | $ - | $ - | $ (6) |
| Zinsverbindlichkeiten | (11) | - | - | (11) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (9.106) | - | - | (9.106) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (12) | - | - | (12) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (41) | - | - | (41) | (50) | - | - | (50) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (22) | - | - | (22) | (22) | - | - | (22) |
| Einlagen von Kontrahenten | (6.250) | - | - | (6.250) | (3.450) | - | - | (3.450) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (168) | - | - | (168) | (49) | - | - | (49) |
| Summe Passiva | $ (15.701) | $ - | $ - | $ (15.701) | $ (3.577) | $ - | $ - | $ (3.577) |

## PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | $ (5) | $ - | $ - | $ (5) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (17) | - | - | (17) |
| Summe Passiva | $ (22) | $ - | $ - | $ (22) |

## PIMCO RAE Fundamental Europe Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | $ (11) | $ - | $ - | $ (11) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (16) | - | - | (16) |
| Summe Passiva | $ (27) | $ - | $ - | $ (27) |

## PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | $ (4) | $ - | $ - | $ (4) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (18) | - | - | (18) |
| Summe Passiva | $ (22) | $ - | $ - | $ (22) |

| PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (1.608) | $ (9) | $ - | $ (1.617) | $ (4.140) | $ - | $ - | $ (4.140) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (3.606) | (3.606) | - | - | (12.442) | (12.442) |
| Zinsverbindlichkeiten | (53) | - | - | (53) | (19) | - | - | (19) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.891) | - | - | (1.891) | (4.874) | - | - | (4.874) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (5.387) | - | - | (5.387) | (5.196) | - | - | (5.196) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | - | - | - | - | (57) | - | - | (57) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (54) | - | - | (54) | (93) | - | - | (93) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (6.439) | - | - | (6.439) | (14.703) | - | - | (14.703) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (1.321) | - | - | (1.321) | - | - | - | - |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (27) | - | - | (27) |
| Einlagen von Kontrahenten | (890) | - | - | (890) | (1.080) | - | - | (1.080) |
| Summe Passiva | $ (17.643) | $ (9) | $ (3.606) | $ (21.258) | $ (30.189) | $ - | $ (12.442) | $ (42.631) |

| PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (32.642) | $ (114) | $ - | $ (32.756) | $ (47.857) | $ - | $ - | $ (47.857) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (82.933) | (82.933) | - | - | (168.650) | (168.650) |
| Zinsverbindlichkeiten | (350) | - | - | (350) | (45) | - | - | (45) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (26.849) | - | - | (26.849) | (28.265) | - | - | (28.265) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (76.186) | - | - | (76.186) | (85.379) | - | - | (85.379) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (541) | - | - | (541) | (6) | - | - | (6) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.346) | - | - | (1.346) | (1.739) | - | - | (1.739) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (59.836) | - | - | (59.836) | (136.429) | - | - | (136.429) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (18.058) | - | - | (18.058) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (18.870) | - | - | (18.870) | (9.160) | - | - | (9.160) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (10.582) | - | - | (10.582) | (39.411) | - | - | (39.411) |
| Summe Passiva | $ (245.260) | $ (114) | $ (82.933) | $ (328.307) | $ (348.291) | $ - | $ (168.650) | $ (516.941) |

| PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (6.066) | $ (20) | $ - | $ (6.086) | $ (10.366) | $ - | $ - | $ (10.366) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | (23.838) | (23.838) |
| Zinsverbindlichkeiten | (44) | - | - | (44) | (16) | - | - | (16) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (5.441) | - | - | (5.441) | (1.478) | - | - | (1.478) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (97.225) | - | - | (97.225) | (24.270) | - | - | (24.270) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (53) | - | - | (53) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (238) | - | - | (238) | (329) | - | - | (329) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (387) | - | - | (387) |
| Einlagen von Kontrahenten | (11.035) | - | - | (11.035) | (17.438) | - | - | (17.438) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (623) | - | - | (623) | (8.946) | - | - | (8.946) |
| Summe Passiva | $ (120.725) | $ (20) | $ - | $ (120.745) | $ (63.230) | $ - | $ (23.838) | $ (87.068) |

| PIMCO RAE Fundamental US Fund | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | $ (4) | $ - | $ - | $ (4) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (18) | - | - | (18) |
| Summe Passiva | $ (22) | $ - | $ - | $ (22) |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

## Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (4.974) | $ (2) | $ - | $ (4.976) | $ (2.765) | $ (20) | $ - | $ (2.785) |
| Zinsverbindlichkeiten | (2) | - | - | (2) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (3.898) | - | - | (3.898) | (7) | - | - | (7) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (6) | - | - | (6) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (235) | - | - | (235) | (245) | - | - | (245) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | - | - | - | - | (2.465) | - | - | (2.465) |
| Einlagen von Kontrahenten | (3.820) | - | - | (3.820) | (55) | - | - | (55) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (1.051) | - | - | (1.051) | (6.782) | - | - | (6.782) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (110) | - | - | (110) | (110) | - | - | (110) |
| Summe Passiva | $ (14.096) | $ (2) | $ - | $ (14.098) | $ (12.430) | $ (20) | $ - | $ (12.450) |

## StocksPLUS™ Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (19.194) | $ (619) | $ - | $ (19.813) | $ (9.883) | $ (3.036) | $ (295) | $ (13.214) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (79.603) | (79.603) | - | - | - | - |
| Zinsverbindlichkeiten | (118) | - | - | (118) | (21) | - | - | (21) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (22.192) | - | - | (22.192) | (17.486) | - | - | (17.486) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (255.133) | - | - | (255.133) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (103) | - | - | (103) | (397) | - | - | (397) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (348) | - | - | (348) | (614) | - | - | (614) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (71.495) | - | - | (71.495) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (284.046) | - | - | (284.046) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (9) | - | - | (9) | (9) | - | - | (9) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (6.638) | - | - | (6.638) | (40.033) | - | - | (40.033) |
| Einlagen von Kontrahenten | (15.670) | - | - | (15.670) | (13.311) | - | - | (13.311) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (299) | - | - | (299) | (16.468) | - | - | (16.468) |
| Summe Passiva | $ (675.245) | $ (619) | $ (79.603) | $ (755.467) | $ (98.222) | $ (3.036) | $ (295) | $ (101.553) |

## Strategic Income Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (3.340) | $ (13) | $ - | $ (3.353) | $ (865) | $ - | $ - | $ (865) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (3.309) | (3.309) | - | - | - | - |
| Zinsverbindlichkeiten | (4) | - | - | (4) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (12.365) | - | - | (12.365) | (779) | - | - | (779) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (5.167) | - | - | (5.167) | (622) | - | - | (622) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (179) | - | - | (179) | (21) | - | - | (21) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (226) | - | - | (226) | (92) | - | - | (92) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (22) | - | - | (22) | (21) | - | - | (21) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (100) | - | - | (100) |
| Einlagen von Kontrahenten | (3.240) | - | - | (3.240) | - | - | - | - |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (1.117) | - | - | (1.117) | (1.860) | - | - | (1.860) |
| Summe Passiva | $ (25.660) | $ (13) | $ (3.309) | $ (28.982) | $ (4.360) | $ - | $ - | $ (4.360) |

## Total Return Bond Fund

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (147.855) | $ (7.162) | $ - | $ (155.017) | $ (173.150) | $ (45.524) | $ (3.421) | $ (222.095) |
| Zinsverbindlichkeiten | (290) | - | - | (290) | (70) | - | - | (70) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (27.616) | - | - | (27.616) | (18.364) | - | - | (18.364) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (4.208.067) | - | - | (4.208.067) | (2.460.926) | - | - | (2.460.926) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (10.360) | - | - | (10.360) | (28.695) | - | - | (28.695) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (7.385) | - | - | (7.385) | (9.395) | - | - | (9.395) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (117.002) | - | - | (117.002) | (115.646) | - | - | (115.646) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (336.424) | - | - | (336.424) | (103.572) | - | - | (103.572) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (124) | - | - | (124) | - | - | - | - |
| Überziehungskredit | - | - | - | - | (4) | - | - | (4) |
| Einlagen von Kontrahenten | (272.077) | - | - | (272.077) | (127.715) | - | - | (127.715) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (32.970) | - | - | (32.970) | (161.872) | - | - | (161.872) |
| Summe Passiva | $ (5.160.170) | $ (7.162) | $ - | $ (5.167.332) | $ (3.199.409) | $ (45.524) | $ (3.421) | $ (3.248.354) |

| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | $ (2.427) | $ (33) | $ - | $ (2.460) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (394) | - | - | (394) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (21) | - | - | (21) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (2.854) | - | - | (2.854) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (32) | - | - | (32) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (81) | - | - | (81) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (172) | - | - | (172) |
| Summe Passiva | $ (5.981) | $ (33) | $ - | $ (6.014) |

| UK Corporate Bond Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | £ (3.122) | £ (1) | £ - | £ (3.123) | £ (1.961) | £ - | £ - | £ (1.961) |
| Zinsverbindlichkeiten | (21) | - | - | (21) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (621) | - | - | (621) | (268) | - | - | (268) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (13.226) | - | - | (13.226) | (8.466) | - | - | (8.466) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (169) | - | - | (169) | (211) | - | - | (211) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (3.202) | - | - | (3.202) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (11.304) | - | - | (11.304) | - | - | - | - |
| Überziehungskredit | (5.611) | - | - | (5.611) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (145) | - | - | (145) | (476) | - | - | (476) |
| Einlagen von Kontrahenten | (97) | - | - | (97) | (1.675) | - | - | (1.675) |
| Summe Passiva | £ (37.518) | £ (1) | £ - | £ (37.519) | £ (13.057) | £ - | £ - | £ (13.057) |

| UK Long Term Corporate Bond Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | £ (4.676) | £ (3) | £ - | £ (4.679) | £ (3.002) | £ - | £ - | £ (3.002) |
| Zinsverbindlichkeiten | (216) | - | - | (216) | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (2.534) | - | - | (2.534) | (2.430) | - | - | (2.430) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (266) | - | - | (266) | (176) | - | - | (176) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (195) | - | - | (195) | (298) | - | - | (298) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (18.970) | - | - | (18.970) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (26.980) | - | - | (26.980) | - | - | - | - |
| Überziehungskredit | (13.065) | - | - | (13.065) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (12.135) | - | - | (12.135) |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.133) | - | - | (1.133) | (3.842) | - | - | (3.842) |
| Summe Passiva | £ (68.035) | £ (3) | £ - | £ (68.038) | £ (21.884) | £ - | £ - | £ (21.884) |

| UK Low Duration Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | £ (2.426) | £ - | £ - | £ (2.426) | £ (2.866) | £ - | £ - | £ (2.866) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (11.469) | - | - | (11.469) | (50) | - | - | (50) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (60) | - | - | (60) | (72) | - | - | (72) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (5.219) | - | - | (5.219) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | - | - | - | - | (33) | - | - | (33) |
| Einlagen von Kontrahenten | (680) | - | - | (680) | (600) | - | - | (600) |
| Summe Passiva | £ (19.854) | £ - | £ - | £ (19.854) | £ (3.621) | £ - | £ - | £ (3.621) |

| UK Real Return Fund | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | Zum 31. Dez. 2014 | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
| Finanzderivate | £ (275) | £ (27) | £ - | £ (302) | £ (1.395) | £ - | £ - | £ (1.395) |
| Zinsverbindlichkeiten | (4) | - | - | (4) | - | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (27) | - | - | (27) | (1.053) | - | - | (1.053) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (10) | - | - | (10) | (23) | - | - | (23) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (577) | - | - | (577) | (20.567) | - | - | (20.567) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (9.303) | - | - | (9.303) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (60) | - | - | (60) | (1.012) | - | - | (1.012) |
| Summe Passiva | £ (10.256) | £ (27) | £ - | £ (10.283) | £ (24.050) | £ - | £ - | £ (24.050) |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

**UK Sterling Long Average Duration Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | £ (317) | £ (7) | £ - | £ (324) | £ (440) | £ - | £ - | £ (440) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (14) | - | - | (14) | (41) | - | - | (41) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (8) | - | - | (8) | (15) | - | - | (15) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (9.335) | - | - | (9.335) | (16.538) | - | - | (16.538) |
| Einlagen von Kontrahenten | (250) | - | - | (250) | (367) | - | - | (367) |
| Summe Passiva | £ (9.924) | £ (7) | £ - | £ (9.931) | £ (17.401) | £ - | £ - | £ (17.401) |

**Unconstrained Bond Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (113.011) | $ (9.822) | $ - | $ (122.833) | $ (220.214) | $ (36.306) | $ (4.482) | $ (261.002) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | - | - | (393.933) | (393.933) | - | - | (1.103.025) | (1.103.025) |
| Zinsverbindlichkeiten | (121) | - | - | (121) | (165) | - | - | (165) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (20.923) | - | - | (20.923) | (16.630) | - | - | (16.630) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (375.791) | - | - | (375.791) | (996.120) | - | - | (996.120) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (10.148) | - | - | (10.148) | (18.847) | - | - | (18.847) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.770) | - | - | (1.770) | (2.396) | - | - | (2.396) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (9.785) | - | - | (9.785) | (286.561) | - | - | (286.561) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (1.028.160) | - | - | (1.028.160) | (129.588) | - | - | (129.588) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | - | - | - | - | (1) | - | - | (1) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (27.580) | - | - | (27.580) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (303.200) | - | - | (303.200) | (225.022) | - | - | (225.022) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (31.735) | - | - | (31.735) | (106.334) | - | - | (106.334) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (2) | - | - | (2) | - | - | - | - |
| Summe Passiva | $ (1.922.226) | $ (9.822) | $ (393.933) | $ (2.325.981) | $ (2.001.878) | $ (36.306) | $ (1.107.507) | $ (3.145.691) |

**US High Yield Bond Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (1.217) | $ - | $ - | $ (1.217) | $ (593) | $ - | $ - | $ (593) |
| Zinsverbindlichkeiten | (168) | - | - | (168) | (5) | - | - | (5) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.279) | - | - | (1.279) | (2.009) | - | - | (2.009) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (884) | - | - | (884) | (2.228) | - | - | (2.228) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (1.147) | - | - | (1.147) | (1.090) | - | - | (1.090) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (391) | - | - | (391) | (340) | - | - | (340) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | - | - | - | - | (173) | - | - | (173) |
| Einlagen von Kontrahenten | (12.280) | - | - | (12.280) | (580) | - | - | (580) |
| Unrealisierte Wertabnahme aus Sicherungsgeschäften | (16.282) | - | - | (16.282) | (19.353) | - | - | (19.353) |
| Summe Passiva | $ (33.648) | $ - | $ - | $ (33.648) | $ (26.371) | $ - | $ - | $ (26.371) |

**US Short-Term Fund**

| Passiva | Zum 31. Dez. 2015 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | Zum 31. Dez. 2014 unter 3 Monaten | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Finanzderivate | $ (2.496) | $ - | $ - | $ (2.496) | $ (1.775) | $ - | $ - | $ (1.775) |
| Zinsverbindlichkeiten | (1) | - | - | (1) | (16) | - | - | (16) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (1.532) | - | - | (1.532) | (92) | - | - | (92) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (119) | - | - | (119) | (9) | - | - | (9) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | - | - | - | - | (5.882) | - | - | (5.882) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (59.405) | - | - | (59.405) | (37.139) | - | - | (37.139) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (33) | - | - | (33) | (22) | - | - | (22) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (686) | - | - | (686) | - | - | - | - |
| Einlagen von Kontrahenten | (380) | - | - | (380) | - | - | - | - |
| Sonstige Verbindlichkeiten | - | - | - | - | (2) | - | - | (2) |
| Summe Passiva | $ (64.652) | $ - | $ - | $ (64.652) | $ (44.937) | $ - | $ - | $ (44.937) |

| | US Small Cap StocksPLUS® Fund | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 31. Dez. 2015 | | | | | |
| **Passiva** | unter 3 Monaten | | 3 Monate - 1 Jahr | Länger als 1 Jahr | Summe | |
| Finanzderivate | $ | (985) | $ - | $ - | $ | (985) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | | - | - | (3.523) | | (3.523) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | | (896) | - | - | | (896) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | | (8.221) | - | - | | (8.221) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | | (23) | - | - | | (23) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | (4.365) | - | - | | (4.365) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | | (22.721) | - | - | | (22.721) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | | (15) | - | - | | (15) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | | (540) | - | - | | (540) |
| Einlagen von Kontrahenten | | (10) | - | - | | (10) |
| Summe Passiva | $ | (37.776) | $ - | $ (3.523) | $ | (41.299) |

**(e) Kredit- und Kontrahentenrisiken** Die Teilfonds setzen sich gegenüber Parteien, mit denen sie Geschäfte tätigen, einem Kreditrisiko aus. Hinzu kommt das Risiko eines Zahlungsausfalls. Die Teilfonds minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie Transaktionen mit einer Vielzahl von Kunden und Kontrahenten an anerkannten und renommierten Börsen durchführen. Bei börsengehandelten Derivaten betrifft das primäre Kreditrisiko die Bonität der Börse selbst bzw. des jeweiligen Clearing-Brokers. Die Teilfonds können Geld verlieren, wenn der Emittent oder Garant eines Rentenwerts oder der Kontrahent eines Derivatkontrakts, Pensionsgeschäfts oder eines Darlehens von Teilfondswertpapieren nicht in der Lage oder nicht bereit ist, Kapital- und/oder Zinszahlungen rechtzeitig vorzunehmen oder anderweitig seinen Verpflichtungen nachzukommen. Wertpapiere unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln.

Wie beim Kreditrisiko können die Teilfonds dem Kontrahentenrisiko oder dem Risiko ausgesetzt sein, dass eine Organisation oder eine andere Einheit, mit der die Teilfonds unbeglichene oder offene Transaktionen haben, säumig wird. Finanzvermögenswerte, die die Teilfonds einem Kontrahentenrisiko aussetzen können, bestehen hauptsächlich aus Barforderungen an Kontrahenten und aus Anlagen. Die Anlageberatungsgesellschaften minimieren das Kontrahentenrisiko für den Teilfonds, indem sie umfangreiche Prüfungen des jeweiligen Kontrahenten vornehmen und die Genehmigung der Risikokommission des Kontrahenten von PIMCO einholen, bevor sie Geschäfte mit Dritten abschließen. Darüber hinaus, wenn nicht eingezahlte Beträge, die einem Teilfonds geschuldet werden, eine vorab festgelegte Schwelle überschreiten, die mit dem Kontrahenten vorab vereinbart wurde, muss dieser Kontrahent dem Teilfonds Sicherheiten in Form von Barmitteln oder barmittelähnlichen Werten in der Höhe vorschießen, die dem Wert des nicht eingezahlten und dem Teilfonds geschuldeten Betrags entsprechen. Der Teilfonds darf diese Sicherheiten in Wertpapiere oder andere Instrumente anlegen und zahlt dem Kontrahenten gewöhnlich Zinsen auf die erhaltenen Sicherheiten. Verringert sich der einem jeden Teilfonds geschuldete Betrag später, wäre der Teilfonds verpflichtet, die Sicherheiten, die dem Teilfonds vorher vorgeschossen wurden, ganz oder teilweise an den Kontrahenten zurückzugeben.

Alle Geschäfte mit notierten Wertpapieren werden bei Lieferung durch zugelassene Kontrahenten abgewickelt/bezahlt. Das Zahlungsunfähigkeitsrisiko gilt als minimal, da die Lieferung der verkauften Wertpapiere ausschließlich erfolgt, wenn die Teilfonds die Zahlung erhalten haben. Die Zahlung für einen Kauf erfolgt, sobald der Kontrahent die Wertpapiere geliefert hat. Das Geschäft schlägt fehl, wenn eine der Parteien ihre Verpflichtungen nicht erfüllt.

**Rahmenaufrechnungsverträge** Bestimmte Teilfonds unterliegen unterschiedlichen Rahmenaufrechnungsvereinbarungen mit ausgewählten Kontrahenten („Rahmenverträge"). Die Rahmenverträge legen die Bedingungen bestimmter Transaktionen fest und verringern das Kontrahentenrisiko, das mit den jeweiligen Transaktionen verbunden ist, indem Schutzmechanismen für die Kreditsicherheit sowie Standardisierungen eingesetzt werden, die die rechtliche Sicherheit erhöhen. Da mit den unterschiedlichen Arten von Transaktionen unterschiedliche Mechanismen verbunden sind und manchmal von verschiedenen Einheiten einer bestimmten Organisation gehandelt werden, kann jede Transaktionsart einem anderen Rahmenvertrag unterliegen und dazu führen, dass mit ein und demselben Kontrahenten mehrere Vereinbarungen notwendig sind. Da die Rahmenverträge für individuelle Aspekte unterschiedlicher Vermögensarten spezifisch sind, ist den Teilfonds im Verzugsfall hinsichtlich aller einem einzigen Vertrag mit einem Kontrahenten unterliegenden Transaktionen eine Glattstellung und Aufrechnung des Gesamtengagement bei einem Kontrahenten möglich.

Rahmenverträge können zu einer Verringerung des Kontrahentenrisikos beitragen, indem Vereinbarungen über das Stellen von Sicherheiten bei vorher festgelegten Risikoniveaus vorgegeben werden. Laut den Rahmenverträgen werden Sicherheiten routinemäßig übertragen, wenn das Nettoengagement insgesamt bei bestimmten Transaktionen (ohne die bereits bestehenden Sicherheiten), die dem betreffenden Rahmenvertrag mit einem Kontrahenten unterliegen, in einem bestimmten Konto über eine bestimmte Schwelle hinausgeht, die normalerweise zwischen Null bis USD 250.000 liegt, je nach dem Kontrahenten und der Art des Rahmenvertrags. United States Treasury Bills und Barmittel in US-Dollar sind im Allgemeinen die bevorzugten Formen von Sicherheiten, obwohl andere Formen von mit AAA bewerteten Wertpapieren oder staatliche Schuldtitel verwendet werden können. Wertpapiere und Barmittel, die als Sicherheiten verwendet werden, werden im Finanzstatus als Vermögenswerte entweder als eine Komponente in dem ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen (übertragbare Wertpapiere) oder als Einlagen bei Kontrahenten (Barmittel) ausgewiesen. Erhaltene Barsicherheiten werden üblicherweise nicht in einem gesonderten Konto gehalten und werden somit im Finanzstatus als Verbindlichkeit als Einlagen von Kontrahenten ausgewiesen. Der Marktwert von als Sicherheiten erhaltener Wertpapiere wird nicht als Komponente des Nettoinventarwerts ausgewiesen. Das allgemeine Kontrahentenrisiko für den Teilfonds kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da es sich mit jeder Transaktion gemäß dem jeweiligen Rahmenvertrag ändert.

Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte und globale Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte (einzeln und zusammen „Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte") regeln Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte und Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Teilfonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Pensionsgeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss, Ertragszahlungen, Verzugsereignisse sowie die Bereitstellung von Sicherheiten.

Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte („Rahmenverträge für Termingeschäfte") regeln den Rahmen und die Faktoren im Zusammenhang mit in der Zukunft liegender Abwicklungen, wie TBA-(to-be-announced)-, Delayed-Delivery- oder Sale-Buyback-Geschäfte zwischen den Teilfonds und ausgewählten Kontrahenten. Die Rahmenverträge für Wertpapier-Termingeschäfte enthalten unter anderem Bestimmungen für den Abschluss und die Bestätigung, die Zahlung und Übertragung, Säumigkeit, die Beendigung sowie die Bereitstellung von Sicherheiten.

Die Rahmenverträge der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenverträge") regeln Transaktionen sowie Freiverkehrsderivat- und Devisenkontrakte zwischen den Teilfonds und ausgewählten Kontrahenten. Die ISDA-Rahmenverträge enthalten Bestimmungen zu allgemeinen Verpflichtungen, Zusicherungen, Vereinbarungen, Sicherheiten und Säumigkeit bzw. Auflösung. Ereignisse, die zur Kündigung des Vertrags führen, umfassen Umstände, die Kontrahenten dazu ermächtigen können, den Vertrag vorzeitig zu beenden und die Begleichung aller ausstehenden Transaktionen nach dem geltenden ISDA-Rahmenvertrag einzuleiten. Eine Entscheidung, den Vertrag vorzeitig zu beenden, könnte sich wesentlich auf den Abschluss auswirken. Unter bestimmten Umständen kann der ISDA-Rahmenvertrag weitere Bestimmungen enthalten, wodurch zusätzlicher Kontrahentenschutz entsteht, der über den Schutz des täglich vorhandenen Risikos hinausgeht, wenn sich die Kreditqualität des Kontrahenten unter ein vorab festgelegtes Niveaus verringert. Diese etwaigen Beträge können bei einer dritten Depotstelle gesondert gehalten werden.

Am 15. September 2008 beantragte Lehman Brothers Holdings Inc. Gläubigerschutz gemäß Kapitel 11 des United States Bankruptcy Code. Am 19. September 2008 wurde nach dem Securities Investor Protection Act (SIPA) gegen den Wertpapiermakler Lehman Brothers Inc. ein Verfahren eingeleitet. Ein in Übereinstimmung mit dem SIPA bestimmter Treuhänder verwaltet die Konkursmasse von Lehman Brothers Inc. Lehman Brothers International (Europe) wurde am 15. September 2008 gemäß dem UK Insolvency Act unter Zwangsverwaltung gestellt. Lehman Brothers Special Financing Inc. beantragte am 3. Oktober 2008 Gläubigerschutz gemäß Kapitel 11 des United States Bankruptcy Code. In Verbindung mit diesen

Anträgen wird die Lehman Brothers-Unternehmensgruppe (gemeinsam „Lehman Brothers“) restrukturiert und/oder, vorbehaltlich der Zustimmung durch das Gericht, ordnungsgemäß liquidiert. Jede Lehman Brothers-Einheit ist eine eigene Rechtseinheit mit eigenem Konkursverfahren. Lehman Brothers Holdings Inc. und die anderen Lehman-Konzernunternehmen, über die ein Chapter 11-Verfahren eröffnet wurde, sind gerade dabei, ihre restlichen Vermögenswerte zu liquidieren und Verteilungen an genehmigte Kreditgeber in Übereinstimmung mit ihrem Third Amended Bankruptcy-Plan, der am 19. Januar 2012 vom Bankruptcy Court genehmigt wurde, vorzunehmen.

Antizipierte Verluste aus den mit Lehman Brothers verbundenen Wertpapier- und Derivattransaktionen wurden als Bestandteil der Forderungen aus verkauften oder zu zahlenden Anlagen im Finanzstatus und realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus Anlagen in der Betriebsergebnisrechnung erfasst. Finanzvermögen und -verbindlichkeiten können miteinander verrechnet und der Nettobetrag kann in den Finanzstatus einbezogen werden, wenn ein juristisch durchsetzbares Recht besteht, die erfassten Beträge miteinander zu verrechnen.

Die Anlageberatungsgesellschaft führt umfangreiche Recherchen und Analysen durch, um das Kreditrisiko der Teilfonds zu bestimmen und zu messen. Die Anlageberatungsgesellschaft überprüft ständig das Kreditrisiko der Teilfonds, um Erträge zu erzielen, indem Anlagen entweder vorgenommen oder gemieden werden. Wertpapiere unterliegen Kreditrisiken unterschiedlichen Grades, die sich oft in den Bonitätsbewertungen widerspiegeln. Die Tabelle unten fasst die Gestaltung der Bonität des Nettovermögens der einzelnen Teilfonds zusammen.

| | PIMCO Asia Local Bond Fund | | PIMCO Capital Securities Fund | | Commodity Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | k. A. | 100 % | 42 % | 43 % | 94 % | 92 % |
| Non-Investment Grade | k. A. | 0 % | 58 % | 57 % | 6 % | 8 % |
| Nicht bewertet | k. A. | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | k. A. | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | PIMCO Credit Absolute Return Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 49 % | 50 % | 63 % | 63 % | 57 % | 62 % |
| Non-Investment Grade | 51 % | 50 % | 37 % | 37 % | 43 % | 38 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | PIMCO Dividend and Income Builder Fund | | Emerging Asia Bond Fund | | Emerging Local Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 52 % | 43 % | 79 % | 78 % | 96 % | 97 % |
| Non-Investment Grade | 48 % | 57 % | 21 % | 22 % | 4 % | 3 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Emerging Markets 2018 Fund | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 49 % | 60 % | 67 % | 84 % | 70 % | 55 % |
| Non-Investment Grade | 51 % | 40 % | 33 % | 16 % | 30 % | 45 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | | PIMCO Emerging Multi-Asset Fund | | Euro Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 91 % | 94 % | k. A. | 79 % | 93 % | 93 % |
| Non-Investment Grade | 9 % | 6 % | k. A. | 21 % | 7 % | 7 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | k. A. | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | k. A. | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | | Euro Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 95 % | 95 % | 69 % | 69 % | 90 % | 94 % |
| Non-Investment Grade | 5 % | 5 % | 31 % | 31 % | 10 % | 6 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Euro Low Duration Fund | | Euro Real Return Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 91 % | 84 % | 99 % | 98 % | 93 % | 85 % |
| Non-Investment Grade | 9 % | 16 % | 1 % | 2 % | 7 % | 15 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Euro Ultra-Long Duration Fund | | Global Advantage Fund | | Global Advantage Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 87 % | 88 % | 83 % | 88 % | 93 % | 94 % |
| Non-Investment Grade | 13 % | 12 % | 17 % | 12 % | 7 % | 6 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Global Bond Fund | | Global Bond Ex-US Fund | | PIMCO Global Dividend Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 89 % | 92 % | 94 % | 96 % | 100 % | k. A. |
| Non-Investment Grade | 11 % | 8 % | 6 % | 4 % | 0 % | k. A. |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | k. A. |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | k. A. |

| | Global High Yield Bond Fund | | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Low Duration Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 13 % | 11 % | 92 % | 90 % | 95 % | 96 % |
| Non-Investment Grade | 87 % | 89 % | 8 % | 10 % | 5 % | 4 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | | Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 92 % | 78 % | 96 % | 97 % | 57 % | 55 % |
| Non-Investment Grade | 8 % | 22 % | 4 % | 3 % | 43 % | 45 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 88 % | 95 % | 96 % | 91 % | 98 % | 90 % |
| Non-Investment Grade | 12 % | 5 % | 4 % | 9 % | 2 % | 10 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund | PIMCO RAE Fundamental Europe Fund | PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund |
|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2015 |
| Investment Grade | 95 % | 92 % | 100 % | 100 % | 100 % |
| Non-Investment Grade | 5 % | 8 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 84 % | 90 % | 85 % | 88 % | 86 % | 87 % |
| Non-Investment Grade | 16 % | 10 % | 15 % | 12 % | 14 % | 13 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | PIMCO RAE Fundamental US FUND | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | | StocksPLUS™ Fund | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 100 % | 82 % | 90 % | 93 % | 95 % |
| Non-Investment Grade | 0 % | 18 % | 10 % | 7 % | 5 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |
|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 |
| Investment Grade | 55 % | 57 % | 94 % | 93 % | 98 % |
| Non-Investment Grade | 45 % | 43 % | 6 % | 7 % | 2 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | | UK Low Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 88 % | 89 % | 89 % | 93 % | 96 % | 96 % |
| Non-Investment Grade | 12 % | 11 % | 11 % | 7 % | 4 % | 4 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | UK Real Return Fund | | UK Sterling Long Average Duration Fund | | Unconstrained Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 |
| Investment Grade | 94 % | 96 % | 95 % | 97 % | 78 % | 81 % |
| Non-Investment Grade | 6 % | 4 % | 5 % | 3 % | 22 % | 19 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

| | US High Yield Bond Fund | | US Short-Term Fund | | US Small Cap StocksPLUS™ Fund |
|---|---|---|---|---|---|
| | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 | 31. Dez. 2014 | 31. Dez. 2015 |
| Investment Grade | 11 % | 10 % | 92 % | 94 % | 94 % |
| Non-Investment Grade | 89 % | 90 % | 8 % | 6 % | 6 % |
| Nicht bewertet | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % | 0 % |
| | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % | 100 % |

Im Wesentlichen werden alle Wertpapiere der Gesellschaft von Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited (die „Depotbank“) treuhänderisch gehalten. Diese Vermögenswerte werden in gesonderten Konten für jeden Teilfonds (in Übereinstimmung mit den OGAW-Richtlinien der Zentralbank) gehalten, was das Ausfallrisiko für den Besitz der aufbewahrten Vermögenswerte reduziert. Die Gesellschaft ist jedoch dem Kreditrisiko eines Kreditinstituts ausgesetzt, das ihre Einlagen hält. Die als Tageseinlagen gehaltenen Barmittel der einzelnen Teilfonds werden bei anerkannten und renommierten Finanzinstituten gehalten, die von der Depotbank auf der Liste der Finanzinstitute geführt werden, bei denen sie Gelder als Tageseinlagen platziert.

## 16. ANTEILSKAPITAL

### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt EUR 38.092 und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je EUR1,27 und 500.000.000.000 Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die ursprünglich als „nicht klassifizierte Anteile“ bezeichnet wurden.

### (b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

### (c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Teilfonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert. Die Anzahl der gewinnberechtigten Anteile hat sich während der zum 31. Dezember 2015 und 31. Dezember 2014 endenden Berichtszeiträume wie folgt verändert (Angaben in Tausend):

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO Asia Local Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (498) | - |
| | (498) | - |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 110 | 58 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (152) | (17) |
| | (42) | 41 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | - |
| | (4) | - |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 71.638 | 28.578 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (29.656) | (8.920) |
| | 41.982 | 19.658 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.381 | 5.113 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (935) | - |
| | 8.446 | 5.113 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.238 | 632 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (214) | (132) |
| | 8.024 | 500 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61.895 | 92.104 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (55.960) | (19.492) |
| | 5.935 | 72.612 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 19.752 | 21.834 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 222 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.897) | (17.364) |
| | 17.856 | 4.692 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.396 | 22.585 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 919 | 432 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.244) | (2.076) |
| | (4.929) | 20.941 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.835 | 2.552 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (699) | (553) |
| | 3.136 | 1.999 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.005 | 3.297 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 29 | 27 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.367) | (2.196) |
| | 2.667 | 1.128 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 2 | - |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 717 | 832 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (65) | (325) |
| | 652 | 507 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 533 | 60 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7) | (14) |
| | 526 | 46 |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.191 | 13.888 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.665) | (2.215) |
| | 3.526 | 11.673 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.383 | 15.621 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.461) | (1.773) |
| | 3.929 | 13.855 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.429 | 2.872 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (803) | (280) |
| | 1.626 | 2.592 |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 267 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (133) | - |
| | 134 | - |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 27.472 | 30.568 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.334) | (7.255) |
| | 17.138 | 23.313 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.050 | 2.086 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 14 | 5 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.355) | (151) |
| | 5.709 | 1.940 |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.028 | 452 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (343) | (56) |
| | 685 | 396 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.110 | 84.276 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (21.405) | (5.547) |
| | 4.705 | 78.729 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 224 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 224 | - |
| Class M Retail: | | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24.335 | 23.437 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 11 | 2 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.360) | (4.663) |
| | 14.986 | 18.776 |
| Class M Retail SGD (Hedged): | | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.650 | 6.202 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 6 | 20 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.003) | (320) |
| | 653 | 5.902 |
| Class R: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 389 | 3.555 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.222) | (345) |
| | (833) | 3.210 |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 428 | 95 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (158) | (1) |
| | 272 | 94 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 609 | 53 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (116) | (11) |
| | 493 | 42 |
| Class S: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 194 | 5.078 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | (4.943) |
| | 184 | 135 |
| Class S CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 50 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 50 | - |
| Class S EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.205 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (859) | - |
| | 1.346 | - |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)** | | |
| Class T: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 426 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (192) | - |
| | 234 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 573 | 2 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (47) | - |
| | 526 | 2 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.382 | 23.807 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1.918 | 1.813 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.849) | (16.926) |
| | (549) | 8.694 |
| Class Z AUD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 154 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 156 | - |
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 32.523 | 15.090 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16.416) | (7.369) |
| | 16.107 | 7.721 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.453 | 2.993 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (458) | (10.240) |
| | 2.995 | (7.247) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (9.941) |
| | - | (9.941) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (34) |
| | - | (34) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 763 | 686 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (622) | (340) |
| | 141 | 346 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Commodity Real Return Fund (Forts.)** | | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.363 | 5.577 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.018) | (4.019) |
| | 2.345 | 1.558 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 335 | 251 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (258) | (875) |
| | 78 | (624) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.843 | 571 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (468) | (307) |
| | 1.375 | 264 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 24 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (30) | - |
| | (30) | 24 |
| **PIMCO Credit Absolute Return Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.413 | 4.292 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.359) | (6.136) |
| | (3.946) | (1.844) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 274 | 365 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (409) | (1.350) |
| | (135) | (985) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.026 | 29.205 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (25.533) | (22.511) |
| | (20.507) | 6.694 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.294 | 23.363 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 433 | 362 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.746) | (7.076) |
| | (6.019) | 16.649 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 457 | 10 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (536) | (187) |
| | (79) | (177) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 141 | 360 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (808) | (205) |
| | (667) | 155 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)** | | |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 19 | 54 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (21) | (34) |
| | (2) | 20 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 557 | 1.994 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (742) | (2.312) |
| | (185) | (318) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.642 | 25.495 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.899) | (28.574) |
| | (9.257) | (3.079) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | - |
| | - | 5 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (2) |
| | (1) | (1) |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3) | - |
| | 4 | 1 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.706 | 5.613 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.426) | (9.507) |
| | (1.720) | (3.894) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 414 | 3.655 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 4 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.037) | (3.855) |
| | (2.623) | (196) |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 59 | 189 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (167) | (116) |
| | (108) | 73 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Diversified Income Fund (Forts.)** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 250 | 172 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (470) | (177) |
| | (220) | (5) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12 | 647 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | (16.984) |
| | 6 | (16.337) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24.521 | 56.760 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (25.436) | (46.895) |
| | (915) | 9.865 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12.885 | 47.833 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 202 | 215 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (29.670) | (273.107) |
| | (16.583) | (225.059) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (540) |
| | - | (540) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.852 | 49.059 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (19.498) | (13.089) |
| | (12.646) | 35.970 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.677 | 11.762 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 68 | 18 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.679) | (28.455) |
| | (934) | (16.675) |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 373 | 208 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (49) | (26) |
| | 324 | 182 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 331 | 701 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (416) | (82) |
| | (85) | 619 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 151 | 13 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (1) |
| | 150 | 12 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 53 | 322 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (218) | (2.978) |
| | (165) | (2.656) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10 | 223 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (286) | (161) |
| | (276) | 62 |
| Administrative Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 107 | 938 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 25 | 17 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (325) | (1.152) |
| | (193) | (197) |
| Administrative EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 391 | 251 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (134) | (1.029) |
| | 257 | (778) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 31 | 18 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (139) | (178) |
| | (108) | (160) |
| Administrative GBP (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 116 | 40 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14) | (186) |
| | 102 | (146) |
| Class E: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.863 | 7.915 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.928) | (15.590) |
| | (2.065) | (7.675) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 19.105 | 24.401 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 534 | 487 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24.088) | (40.848) |
| | (4.449) | (15.960) |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.702 | 10.979 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (20.512) | (35.878) |
| | (12.810) | (24.899) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.012 | 12.783 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 9 | 13 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (25.311) | (49.790) |
| | (18.290) | (36.994) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | |
| Class E SGD (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 86 | 215 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 6 | 9 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (261) | (532) |
| | (169) | (308) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24 | 25 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | - |
| | 18 | 25 |
| Class G Retail EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 23 | 108 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (47) | (4) |
| | (24) | 104 |
| Class H Institutional: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 30.676 | 40.806 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (36.730) | (47.052) |
| | (6.054) | (6.246) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | (1) | - |
| Class M Retail: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.550 | 2.782 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 70 | 119 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.822) | (25.632) |
| | (4.202) | (22.731) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.968 | 8.155 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.953) | (7.511) |
| | 1.016 | 644 |
| Class M Retail AUD (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.132 | 1.469 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 11 | 15 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (899) | (1.262) |
| | 244 | 222 |
| Class R: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (39) |
| | - | (1) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 258 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (258) | (41) |
| | (258) | 217 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | 11 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (26) | (17) |
| | (18) | (6) |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 25 | 40 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (36) | (70) |
| | (10) | (30) |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 35 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7) | - |
| | 28 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 31 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | - |
| | 27 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 178 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (70) | - |
| | 108 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 84 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5) | - |
| | 79 | 1 |
| Class Z: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 2.424 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (2.424) |
| | - | - |

| | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.328 | 5.330 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.673) | (7.607) |
| | (3.345) | (2.277) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | - |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.537 | 1.841 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.907) | (34.241) |
| | (5.370) | 32.400 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.) | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 481 | 11.382 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 808 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.108) | (15.815) |
| | (10.627) | (3.625) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 17.106 | 7.782 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (629) | (772) |
| | 16.477 | 7.010 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 334 | 2.154 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.449) | (825) |
| | (1.115) | 1.329 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 35 | 754 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (74) | (16) |
| | (39) | 738 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 253 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (86) | - |
| | (86) | 256 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.449 | 6.173 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.905) | (2.379) |
| | (2.456) | 3.794 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.587 | 8.849 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 44 | 86 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.877) | (19.251) |
| | (5.246) | (10.316) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.549 | 7.161 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (36.548) | (57.610) |
| | (33.999) | (50.449) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 588 | 2.654 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.586) | (910) |
| | (998) | 1.744 |
| Class E SGD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15 | 292 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 2 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (89) | (249) |
| | (72) | 45 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)** | | |
| Class R: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 73 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (55) | (136) |
| | (55) | (63) |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 3 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 27 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | - |
| | 18 | 1 |
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 220 | 176 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (160) | - |
| | 60 | 176 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 613 | 3.647 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 5 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (748) | (3.274) |
| | (132) | 378 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 53 | 7 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11) | - |
| | 42 | 7 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.077 | 7.218 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.505) | (8.783) |
| | (1.428) | (1.565) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 136 | 184 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (71) | (4) |
| | 65 | 180 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund (Forts.)** | | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 617 | 102 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24) | - |
| | 593 | 102 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 720 | 1.823 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 24 | 26 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.306) | (867) |
| | (562) | 982 |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | - |
| | 1 | - |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.295 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (115) | - |
| | 1.180 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.240 | 1.744 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.312) | (2.061) |
| | (72) | (316) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | - |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | 44 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8) | (5) |
| | - | 40 |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 45 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5) | - |
| | 40 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 11 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 3 | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund (Forts.)** | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 105 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 105 | 1 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (563) | (621) |
| | (563) | (621) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | (1) | - |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 109 | 214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (136) | (6.229) |
| | (27) | (6.015) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 48 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (4.786) |
| | - | (4.738) |
| Class E: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 764 | 1.415 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.130) | (3.064) |
| | (1.364) | (1.646) |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 102 | 90 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (124) | (13.798) |
| | (22) | (13.708) |
| Class M Retail HKD (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 112 | 482 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.902) | (16.940) |
| | (10.790) | (16.458) |
| **Emerging Local Bond Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.420 | 60.618 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (46.301) | (50.925) |
| | (38.881) | 9.693 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Emerging Local Bond Fund (Forts.)** | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.518 | 16.531 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1.968 | 3.617 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.168) | (54.801) |
| | (9.682) | (34.653) |
| Institutional CAD (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (38) | (36) |
| | (38) | (36) |
| Institutional CHF (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 224 | 8.572 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.869) | (298) |
| | (6.645) | 8.274 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14.262 | 18.250 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22.174) | (33.160) |
| | (7.912) | (14.910) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15.828 | 51.529 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 305 | 178 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (27.596) | (71.943) |
| | (11.463) | (20.236) |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.171 | 10.450 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.458) | (8.419) |
| | (5.287) | 2.031 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 80 | 34 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (131) | (45) |
| | (51) | (11) |
| Institutional ILS (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 96 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (2.446) |
| | - | (2.350) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 134 | 914 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.063) | (5.323) |
| | (929) | (4.409) |
| Investor CHF (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 104 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (450) | (416) |
| | (450) | (312) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Local Bond Fund (Forts.) | |
| Investor EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21 | 146 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (253) | (840) |
| | (232) | (694) |
| Administrative EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | (109) |
| | (4) | (109) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 831 | 1.885 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.307) | (9.303) |
| | (8.476) | (7.418) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 528 | 1.214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 5 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.347) | (1.848) |
| | (814) | (628) |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.696 | 12.818 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (19.844) | (22.703) |
| | (13.148) | (9.885) |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15 | 12 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | 5 | 12 |
| Class G Retail EUR (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 76 | 252 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.524) | (698) |
| | (1.448) | (446) |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14) | (51) |
| | (6) | (51) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 47 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (47) |
| | - | - |
| Class S CHF (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 15 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (692) |
| | - | (677) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Local Bond Fund (Forts.) | |
| Class S EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 3 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (31) |
| | - | (28) |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 419 | 301 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 69 | 130 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (758) | (10.484) |
| | (270) | (10.053) |
| | Emerging Markets 2018 Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 68 | 107 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (61) | - |
| | 7 | 107 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.453 | 2.460 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1.453 | 2.460 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 93 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 93 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 606 | 101 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (38) | - |
| | 568 | 101 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 99 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 99 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 38 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 5 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets 2018 Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | 1 |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 106 | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | - |
| | 100 | 4 |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 14 | 1 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 62 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 62 |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class S CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| | Emerging Markets Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.787 | 18.447 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16.986) | (20.107) |
| | (10.199) | (1.660) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.600 | 5.138 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1.025 | 1.549 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.397) | (2.920) |
| | 1.228 | 3.767 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 477 | 628 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (26.245) | (163) |
| | (25.768) | 465 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.618 | 9.370 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.316) | (16.708) |
| | 1.302 | (7.338) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 28.528 | 27.703 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 124 | 71 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (19.547) | (20.437) |
| | 9.105 | 7.337 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (2.994) |
| | - | (2.994) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.306 | 1.568 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.834) | (2.837) |
| | (2.528) | (1.269) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 409 | 1.214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 39 | 25 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (690) | (875) |
| | (242) | 364 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 56 | 57 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (177) | (233) |
| | (121) | (176) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 13 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (196) | (123) |
| | (196) | (110) |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66 | 34 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (96) | (114) |
| | (30) | (80) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 7 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (2.425) |
| | - | (2.418) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24 | 607 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (270) | (1.167) |
| | (246) | (560) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.334 | 9.406 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.191) | (11.297) |
| | (857) | (1.891) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.266 | 2.237 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 143 | 115 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.544) | (5.295) |
| | (135) | (2.943) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.874 | 6.267 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.757) | (6.146) |
| | (6.883) | 121 |
| Class E SGD (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 23 | 67 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (56) | (138) |
| | (33) | (71) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.557 | 1.450 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.048) | (2.130) |
| | (491) | (680) |
| Class M Retail: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 477 | 1.797 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 21 | 34 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.599) | (9.101) |
| | (1.101) | (7.270) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.327 | 12.126 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.271) | (7.788) |
| | (2.944) | 4.338 |
| Class M Retail AUD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 85 | 1.150 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 4 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (477) | (1.170) |
| | (389) | (16) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond Fund (Forts.) | |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 14 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (40) | (26) |
| | (40) | (12) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 26 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (56) | (43) |
| | (56) | (17) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12) | (5) |
| | (12) | (5) |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (23) |
| | - | (23) |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 700 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (686) | (14) |
| | (686) | 686 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 107 | 223 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 18 | 31 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (286) | (415) |
| | (161) | (161) |
| | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.170 | 11.101 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16.507) | (8.600) |
| | (11.337) | 2.501 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.257 | 3.842 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 911 | 1.318 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (72) | (11) |
| | 7.096 | 5.149 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 49 | 460 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (739) | (2.303) |
| | (690) | (1.843) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.) | |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.607 | 7.724 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.354) | (19.213) |
| | (3.747) | (11.489) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (2.919) |
| | - | (2.919) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11 | 2.154 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 28 | 48 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.496) | (1.508) |
| | (3.457) | 694 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | (10) | - |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 15 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (25) | (173) |
| | (25) | (158) |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 225 | 327 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (249) | (460) |
| | (24) | (133) |
| Administrative Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | 10 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (72) | (527) |
| | (68) | (516) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 260 | 746 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.409) | (6.290) |
| | (3.149) | (5.544) |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 109 | 1.006 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.334) | (6.799) |
| | (8.225) | (5.793) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 251 | 640 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.148) | (18.899) |
| | (4.897) | (18.259) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.) | |
| Class M Retail: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 22 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (46) | (108) |
| | (46) | (86) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | (1) | - |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 8 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | (14) |
| | (9) | (6) |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 21 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (85) | (96) |
| | (85) | (75) |
| Class S EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 63 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (83) | (200) |
| | (81) | (137) |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 134 | 242 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 140 | 204 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.073) | (3.370) |
| | (1.799) | (2.924) |
| | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.010 | 3.872 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.976) | (4.144) |
| | (1.966) | (272) |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 335 | 1.349 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (941) | (8.310) |
| | (606) | (6.961) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 111 | 285 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (517) | (2.886) |
| | (406) | (2.601) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)** | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15 | 60 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (218) | (382) |
| | (202) | (321) |
| Class E EUR (Unhedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 152 | 103 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (871) | (14.504) |
| | (719) | (14.401) |
| **PIMCO Emerging Multi-Asset Fund** | | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | 140 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (85) | (135) |
| | (79) | 5 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 77 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (491) | (69) |
| | (490) | 8 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22) | - |
| | (22) | - |
| Class E EUR (Partially Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 93 | 117 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.066) | (768) |
| | (973) | (651) |
| Class G Retail EUR (Partially Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23) | (1) |
| | (14) | (1) |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 486 | 2.256 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (53.841) | - |
| | (53.355) | 2.256 |
| **PIMCO EqS Emerging Markets Fund** | | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 2.960 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (232) | (13.376) |
| | (232) | (10.416) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO EqS Emerging Markets Fund (Forts.)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 840 | 9.811 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.540) | (38.066) |
| | (5.700) | (28.255) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 7.566 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 367 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.282) | (11.496) |
| | (9.282) | (3.563) |
| Class E EUR (Unhedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 127 | 33.503 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31.511) | (58.782) |
| | (31.384) | (25.279) |
| Class R GBP (Unhedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 5.949 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 103 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.558) | (13.053) |
| | (3.558) | (7.001) |
| **PIMCO EqS Pathfinder Fund™** | | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | 2.396 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (464) | (2.526) |
| | (460) | (130) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 14 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (6.262) |
| | - | (6.248) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26 | 1.695 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.934) | (13.244) |
| | (2.908) | (11.549) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (4.242) |
| | - | (4.242) |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (1) |
| | (1) | (1) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO EqS Pathfinder Fund™ (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 150 | 422 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.204) | (897) |
| | (3.054) | (475) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 45 | 93 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (170) | (70) |
| | (125) | 23 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 167 | 724 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.975) | (22.968) |
| | (3.808) | (22.244) |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 3.269 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 104 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.359) | (41) |
| | (3.359) | 3.332 |
| | PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 35 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (103) | (29) |
| | (101) | 6 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 410 | 635 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.010) | (966) |
| | (2.600) | (331) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 45 | 105 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (228) | (115) |
| | (183) | (10) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™ (Forts.) | |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| | Euro Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.346 | 18.097 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18.973) | (14.983) |
| | 7.373 | 3.114 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.076 | 957 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 5 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.790) | (203) |
| | 287 | 759 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 178 | 673 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (235) | (126) |
| | (57) | 547 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 284 | 396 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.212) | (1.280) |
| | (928) | (884) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 29 | 110 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (145) | (457) |
| | (116) | (347) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16 | 24 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (36) | (317) |
| | (20) | (293) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.007 | 4.153 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.570) | (2.677) |
| | (1.563) | 1.476 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.295 | 2.427 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.735) | (1.492) |
| | 560 | 935 |
| Class G Institutional: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 22 | 32 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (28) | - |
| | (6) | 32 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Euro Bond Fund (Forts.)** | | |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.059 | 9.334 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.197) | (16.277) |
| | (9.138) | (6.943) |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 47 | 2 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (20) | - |
| | 27 | 2 |
| **Euro Credit Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.048 | 6.231 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.719) | (3.757) |
| | (671) | 2.474 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 99 | 10.535 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 137 | 191 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.823) | (1.547) |
| | (6.587) | 9.179 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.100 | 24.347 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18.493) | (2.120) |
| | (17.393) | 22.227 |
| **Euro Income Bond Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.485 | 10.766 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16.619) | (3.557) |
| | (6.134) | 7.209 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.340 | 2.241 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 5 | 12 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.234) | (541) |
| | 6.111 | 1.712 |
| Investor Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 752 | 638 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (625) | (289) |
| | 127 | 349 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.669 | 13.630 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.097) | (3.498) |
| | (3.428) | 10.132 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Euro Income Bond Fund (Forts.)** | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.754 | 46.284 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18.152) | (9.431) |
| | (7.398) | 36.853 |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 153 | 3 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31) | - |
| | 122 | 3 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 88 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | 78 | 1 |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.399 | 11.832 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.407) | (4.311) |
| | (5.008) | 7.521 |
| **Euro Low Duration Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.716 | 19.699 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22.445) | (22.612) |
| | (14.729) | (2.913) |
| Institutional AUD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.000 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1.000 | - |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 879 | 27.447 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.456) | (67.058) |
| | (577) | (39.611) |
| **Euro Real Return Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 641 | 198 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (585) | (64) |
| | 56 | 134 |
| **Euro Short-Term Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 79.493 | 21.162 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (46.598) | (21.810) |
| | 32.895 | (648) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Euro Short-Term Fund (Forts.)** | | |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24 | 112 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (126) | (279) |
| | (102) | (167) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.755 | 13.476 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.891) | (4.421) |
| | (11.136) | 9.055 |
| **Euro Ultra-Long Duration Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.008 | 2.010 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.284) | (2.131) |
| | (2.276) | (121) |
| **Global Advantage Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14 | 352 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (515) | (2.442) |
| | (501) | (2.090) |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 135 | 705 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 248 | 208 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.288) | (700) |
| | (1.905) | 213 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 13.971 | 2.853 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.744) | (1.733) |
| | 12.227 | 1.120 |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 33 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (25) |
| | - | 8 |
| Institutional NOK (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 306 | 550 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 306 | 550 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (639) |
| | - | (639) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Global Advantage Fund (Forts.)** | | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 45 | 125 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (655) | (1.181) |
| | (610) | (1.056) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16) | (11) |
| | (13) | (2) |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 115 | 110 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (645) | (1.348) |
| | (530) | (1.238) |
| Class R GBP (Partially Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (36) |
| | - | (36) |
| Class T EUR (Partially Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 5 | 1 |
| **Global Advantage Real Return Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 334 | 3.031 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.572) | (2.988) |
| | (4.238) | 43 |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 111 | 84 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.219) | (514) |
| | (1.108) | (430) |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 13.154 | 6.097 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17.734) | (5.529) |
| | (4.580) | 568 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 585 | 818 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (530) | (986) |
| | 55 | (168) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Advantage Real Return Fund (Forts.) | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.815 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 119 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (415) | - |
| | 4.519 | - |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 390 | 1.484 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.262) | (5.873) |
| | (1.872) | (4.389) |
| Institutional USD (Partially Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 649 | 18.028 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18.677) | - |
| | (18.028) | 18.028 |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 113 | 3 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (115) | (232) |
| | (2) | (229) |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 1.083 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (120) |
| | 9 | 963 |
| Investor GBP (Partially Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 2 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (115) |
| | - | (113) |
| Class E: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 231 | 241 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (182) | (215) |
| | 49 | 26 |
| Class E EUR (Partially Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 25.007 | 169 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.472) | (481) |
| | 15.535 | (312) |
| Class G Institutional EUR (Partially Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Advantage Real Return Fund (Forts.) | |
| Class R GBP (Partially Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 160 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3) | (178) |
| | (1) | (18) |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 3.055 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 48 | 46 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1.449) |
| | 48 | 1.652 |
| | Global Bond Fund | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.007 | 16.050 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.042) | (10.751) |
| | 965 | 5.299 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.999 | 3.985 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 41 | 58 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.829) | (9.082) |
| | 1.211 | (5.039) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 901 | 1.433 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.759) | (2.246) |
| | (858) | (813) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.698 | 1.275 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 142 | 161 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.156) | (1.653) |
| | 684 | (217) |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.859 | 395 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.828) | (1.651) |
| | (1.969) | (1.256) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15.134 | 10.971 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.205) | (10.057) |
| | 3.929 | 914 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.979 | 3.119 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (271) | (872) |
| | 1.715 | 2.250 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (31) |
| | - | (31) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.021 | 1.548 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (809) | (7.790) |
| | 6.212 | (6.242) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12.157 | 2.688 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 17 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (915) | (3.641) |
| | 11.259 | (946) |
| Institutional ILS (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | 146 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (21) | (727) |
| | (14) | (581) |
| Institutional NOK (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 675 | 828 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18) | (8.309) |
| | 657 | (7.481) |
| Institutional NZD (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.633 | 665 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 284 | 449 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.300) | (2.601) |
| | (4.383) | (1.487) |
| Institutional SEK (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | 230 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (58) | (273) |
| | (52) | (43) |
| Institutional SGD (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 36 | 476 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.495) | (15.451) |
| | (4.459) | (14.975) |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.149 | 5.395 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.090) | (12.526) |
| | 1.059 | (7.131) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 284 | 579 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.945) | (496) |
| | (1.661) | 83 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.107 | 4.221 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.716) | (4.304) |
| | (1.609) | (83) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.587 | 189 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (522) | (1.488) |
| | 1.065 | (1.299) |
| Investor CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.074 | 6.249 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.010) | (3.209) |
| | 3.064 | 3.040 |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.894 | 1.112 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.244) | (1.633) |
| | 650 | (521) |
| Investor GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 332 | 80 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (177) | (644) |
| | 155 | (564) |
| Investor NOK (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 48 | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (84) | (225) |
| | (36) | (187) |
| Investor USD (Currency Exposure) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18 | 62 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (156) | (446) |
| | (138) | (384) |
| Administrative Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 623 | 68 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (307) | (485) |
| | 316 | (417) |
| Administrative GBP (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 19 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | (37) |
| | 10 | (36) |
| Class E: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.954 | 4.527 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.697) | (4.737) |
| | 1.257 | (210) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 20.597 | 20.878 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 175 | 62 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17.527) | (15.989) |
| | 3.245 | 4.951 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.310 | 3.502 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.039) | (6.735) |
| | 271 | (3.233) |
| Class E GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61 | 114 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (73) | (294) |
| | (9) | (177) |
| Class E USD (Currency Exposure): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.567 | 220 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (330) | (503) |
| | 4.237 | (283) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 182 | 145 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (133) | (132) |
| | 50 | 13 |
| Class G Institutional: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.682 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (204) | - |
| | 9.478 | - |
| Class G Retail EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.833 | 6.814 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.271) | (7.848) |
| | 3.563 | (1.034) |
| Class H Institutional: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.647 | 17.522 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12.222) | (8.661) |
| | (4.575) | 8.861 |
| Class R: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 105 | 46 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (58) | (23) |
| | 47 | 23 |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66 | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (30) | (149) |
| | 36 | (144) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 48 | 139 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (64) | (111) |
| | (16) | 28 |
| Class R USD (Currency Exposure): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (7) |
| | 3 | (7) |
| Class S: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.486 | 70 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.624) | (1.720) |
| | (138) | (1.650) |
| Class S GBP (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16 | 83 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13) | (1.863) |
| | 3 | (1.780) |
| Class T: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 230 | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (37) | - |
| | 193 | 5 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 56 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 54 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 185 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (57) | - |
| | 128 | 1 |
| Class Z USD (Currency Exposure): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| | Global Bond Ex-US Fund | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12.172 | 7.348 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.683) | (9.127) |
| | 1.489 | (1.779) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 946 | 711 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 40 | 53 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.093) | (696) |
| | (107) | 68 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Global Bond Ex-US Fund (Forts.)** | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.353 | 847 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (951) | (233) |
| | 402 | 614 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 408 | 294 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (211) | (722) |
| | 197 | (428) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 114 | 508 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (544) | (253) |
| | (430) | 255 |
| Class E: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.355 | 2.531 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 5 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.840) | (2.146) |
| | (1.478) | 390 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 123 | 62 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15) | (56) |
| | 108 | 6 |
| **PIMCO Global Dividend Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 73 | 24 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23) | - |
| | 50 | 24 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 32 | 952 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | 131 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (746) | (14.530) |
| | (710) | (13.447) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.887 | 5.218 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.366) | (13.706) |
| | (479) | (8.488) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 44 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (6.665) |
| | 11 | (6.620) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (10.088) |
| | - | (10.088) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO Global Dividend Fund (Forts.)** | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (14) |
| | - | (14) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 453 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (28) | - |
| | 425 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 459 | 472 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 18 | 9 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (304) | (363) |
| | 173 | 118 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 739 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (54) | - |
| | 685 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 477 | 533 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 233 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (567) | (30.352) |
| | (90) | (29.586) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12 | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | 2 | 9 |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 30 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 28 | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO Global Dividend Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3) | - |
| | 2 | 1 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 174 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (17.221) |
| | - | (17.047) |
| | Global High Yield Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 33.419 | 21.885 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (20.609) | (43.407) |
| | 12.810 | (21.522) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.459 | 5.448 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 265 | 121 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.529) | (11.625) |
| | (5.805) | (6.056) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.104 | 978 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (260) | (2.908) |
| | 844 | (1.930) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 606 | 98 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (98) | (49) |
| | 508 | 49 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.901 | 30.253 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23.920) | (46.822) |
| | (7.019) | (16.569) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.595 | 1.102 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 76 | 111 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.302) | (3.598) |
| | 1.369 | (2.385) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 2.451 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (5.285) |
| | - | (2.834) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.492 | 1.137 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.771) | (3.829) |
| | 721 | (2.692) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 44.497 | 21.596 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 171 | 606 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24.815) | (52.670) |
| | 19.853 | (30.468) |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (202) | (1.190) |
| | (202) | (1.181) |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.007 | 3.249 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.256) | - |
| | (3.249) | 3.249 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.511 | 509 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.770) | (795) |
| | (259) | (286) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.542 | 8.912 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.556) | (15.754) |
| | 2.986 | (6.842) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | 33 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 14 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (39) | (571) |
| | (32) | (524) |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 116 | 581 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 2 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.047) | (1.911) |
| | (929) | (1.328) |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 51 | 21 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | 4 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (363) | (385) |
| | (308) | (360) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 20.543 | 32.635 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (21.116) | (37.237) |
| | (573) | (4.602) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 29.690 | 17.415 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 195 | 159 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (34.891) | (24.219) |
| | (5.006) | (6.645) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.743 | 3.968 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.431) | (13.286) |
| | (2.688) | (9.318) |
| Class E GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21 | 81 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (168) | (332) |
| | (147) | (250) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 44 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 44 | - |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 351 | 548 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (777) | (228) |
| | (426) | 320 |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 31.153 | 15.123 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24.542) | (14.641) |
| | 6.611 | 482 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 417 | 508 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 11 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (805) | (1) |
| | (377) | 514 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 18.528 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 8 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (18.537) |
| | - | (1) |
| Class M Retail: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.527 | 8.195 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 25 | 41 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.175) | (14.962) |
| | 377 | (6.726) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 32.294 | 22.715 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31.494) | (19.201) |
| | 800 | 3.514 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 52 | 60 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23) | (44) |
| | 29 | 16 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 89 | 117 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (128) | (134) |
| | (39) | (17) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 13 | 47 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8) | (62) |
| | 5 | (15) |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 110 | 61 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (42) | (157) |
| | 68 | (96) |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 223 | 81 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (125) | - |
| | 98 | 81 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 115 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5) | - |
| | 111 | 1 |
| | Global Investment Grade Credit Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 77.419 | 43.730 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (57.581) | (47.258) |
| | 19.838 | (3.528) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.407 | 13.593 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 521 | 607 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23.793) | (21.951) |
| | (6.865) | (7.751) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11.719 | 4.444 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.838) | (9.778) |
| | (4.119) | (5.334) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.441 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (271) | - |
| | 7.170 | - |
| Institutional CZK (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 60.197 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1.365 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 61.562 | - |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.243 | 555 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (669) | (272) |
| | 574 | 283 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61.054 | 24.864 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22.930) | (92.046) |
| | 38.124 | (67.182) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21.459 | 136.920 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 460 | 184 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12.788) | (196.587) |
| | 9.131 | (59.483) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (11.726) |
| | - | (11.726) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.671 | 7.252 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.917) | (21.461) |
| | 754 | (14.209) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 41.219 | 17.013 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 32 | 24 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23.831) | (17.426) |
| | 17.420 | (389) |
| Institutional HUF (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 310.309 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 8.731 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 319.040 | - |
| Institutional ILS (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 276 | 933 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (639) | (5.472) |
| | (363) | (4.539) |
| Institutional NOK (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.251 | 2.401 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.162) | (6.888) |
| | 1.089 | (4.487) |
| Institutional NZD (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 95 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15) | (2.739) |
| | (15) | (2.644) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Institutional PLN (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.815 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 5.815 | - |
| Institutional SEK (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.086 | 498 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.548) | (43.867) |
| | 538 | (43.369) |
| Institutional SGD (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 133 | 117 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (135) | (254) |
| | (2) | (137) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 2 | - |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.678 | 769 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.906) | (160) |
| | 772 | 609 |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.286 | 4.067 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.974) | (12.168) |
| | (688) | (8.101) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.344 | 1.297 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 10 | 16 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.485) | (4.002) |
| | (1.131) | (2.689) |
| Investor CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 203 | 320 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (388) | (814) |
| | (185) | (494) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 312 | 541 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 2 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (996) | (1.166) |
| | (682) | (623) |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.396 | 1.182 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.381) | (5.762) |
| | (1.985) | (4.580) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.511 | 1.972 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.057) | (3.740) |
| | (3.543) | (1.761) |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 144 | 123 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 4 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (748) | (758) |
| | (601) | (631) |
| Investor SGD (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 49 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (103) | (145) |
| | (54) | (145) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.223 | 552 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.069) | (6.513) |
| | (1.846) | (5.961) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.303 | 604 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 6 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.611) | (3.965) |
| | (302) | (3.355) |
| Administrative CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 84 | 241 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (58) | (29) |
| | 26 | 212 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 157 | 312 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (838) | (579) |
| | (681) | (267) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21 | 51 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (26) | (277) |
| | (5) | (226) |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 172 | 26 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (62) | (152) |
| | 113 | (123) |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24.006 | 20.216 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17.894) | (5.688) |
| | 6.112 | 14.528 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14.090 | 11.850 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.211) | (23.452) |
| | (121) | (11.602) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 31.041 | 6.214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 154 | 61 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (28.780) | (19.820) |
| | 2.415 | (13.545) |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 452 | 654 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.636) | (1.986) |
| | (1.184) | (1.332) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.569 | 3.895 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.049) | (37.081) |
| | (5.480) | (33.186) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.110 | 2.527 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.929) | (12.132) |
| | (3.817) | (9.604) |
| Class E GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 728 | 563 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 11 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.656) | (3.947) |
| | (2.917) | (3.377) |
| Class E SGD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 831 | 222 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (424) | (891) |
| | 410 | (668) |
| Class G Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.313 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (281) | - |
| | 3.032 | - |
| Class G Retail EUR (Currency Exposure): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61 | 392 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17) | - |
| | 44 | 392 |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | 22 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17) | (33) |
| | (13) | (11) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.583 | 7.657 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.366) | (3.975) |
| | (2.783) | 3.682 |
| Class M Retail: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.661 | 529 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 2 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.689) | (356) |
| | (26) | 175 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 29.744 | 5.539 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22.687) | (5.145) |
| | 7.058 | 394 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.398 | 228 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (621) | (517) |
| | 777 | (289) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 93 | 76 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (92) | (199) |
| | 1 | (123) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 27 | 49 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (25) | (5) |
| | 2 | 44 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 27 | 37 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 25 | 37 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 983 | 1.132 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (413) | (557) |
| | 570 | 575 |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.098 | 15.148 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.365) | (5.360) |
| | (7.267) | 9.788 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 230 | 2.415 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (186) | (1) |
| | 44 | 2.414 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | |
| Class S CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.963 | 4.214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.186) | (1.800) |
| | 2.777 | 2.414 |
| Class S EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14.694 | 11.800 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (16.448) | (10.433) |
| | (1.754) | 1.367 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 15 | 1 |
| Class S GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 954 | 2.053 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (162) | (8) |
| | 792 | 2.045 |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 65 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 35 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | - |
| | 26 | 1 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | 1 | (7.724) |
| | 1 | (7.724) |

| | |
|---|---|
| | Global Low Duration Real Return Fund |
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.342 | 11.443 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12.749) | (2.531) |
| | (3.407) | 8.912 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 134 | 437 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (89) | (214) |
| | 45 | 223 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Low Duration Real Return Fund (Forts.) | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 106 | 969 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (69) | (15) |
| | 37 | 954 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21.596 | 11.845 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11.627) | (3.832) |
| | 9.969 | 8.013 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 161 | 10.066 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7) | (9.979) |
| | 154 | 87 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.137 | 5.941 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.483) | - |
| | (1.339) | 5.941 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 22 | 297 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (20) |
| | 22 | 277 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 285 | 2.595 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (163) | (463) |
| | 122 | 2.132 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.001 | 430 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (725) | (60) |
| | 3.276 | 370 |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.984 | 20.909 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.011) | (125) |
| | (4.027) | 20.784 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Multi-Asset Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.987 | 654 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.382) | (21.457) |
| | 1.605 | (20.803) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | (34) |
| | (6) | (34) |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (109) |
| | - | (100) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | 13 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (285) | (25) |
| | (277) | (12) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.463 | 1.014 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.221) | (20.261) |
| | 10.242 | (19.247) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15) | (178) |
| | (8) | (178) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 165 | 309 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (41) | (623) |
| | 124 | (314) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 83 | 6 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 5 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (180) | (13.854) |
| | (96) | (13.843) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 47 | 101 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (121) | (812) |
| | (74) | (711) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 106 | 13 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (18) | (320) |
| | 90 | (306) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Multi-Asset Fund (Forts.) | |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 124 | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (76) | (123) |
| | 48 | (114) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.739 | 1.345 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.082) | (7.102) |
| | (343) | (5.757) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 542 | 253 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (224) | (468) |
| | 318 | (215) |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (77) | (6) |
| | (77) | (6) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.633 | 1.015 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.281) | (14.174) |
| | (2.648) | (13.159) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 683 | 319 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.293) | (2.177) |
| | (610) | (1.857) |
| Class E GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (47) | (30) |
| | (40) | (30) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 3 | - |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 156 | 62 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (123) | (402) |
| | 33 | (340) |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | 11 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (51) | (144) |
| | (45) | (133) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Multi-Asset Fund (Forts.) | |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (19) | (7) |
| | (19) | (7) |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 3 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (103) | (127) |
| | (103) | (124) |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (56.675) |
| | - | (56.675) |
| | Global Real Return Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.925 | 7.993 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.564) | (6.675) |
| | (639) | 1.318 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.690 | 590 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 23 | 9 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.883) | (1.634) |
| | 830 | (1.035) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 853 | 229 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (485) | (4.687) |
| | 368 | (4.458) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | - |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.945 | 18.468 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (23.762) | (38.743) |
| | 3.183 | (20.275) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 604 | 2.479 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 16 | 17 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (727) | (4.063) |
| | (107) | (1.567) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.240 | 10.307 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 151 | 86 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.361) | (10.684) |
| | 8.030 | (291) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Real Return Fund (Forts.) | |
| Institutional GBP (Currency Exposure) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (183) | (1.455) |
| | (183) | (1.455) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 866 | 286 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.372) | (1.531) |
| | (506) | (1.245) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 880 | 1.240 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.099) | (7.949) |
| | (1.212) | (6.703) |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 13.014 | 125 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3) | - |
| | 13.011 | 125 |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 8 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8) | (1.480) |
| | (8) | (1.472) |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 951 | 1.344 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.847) | (4.833) |
| | (896) | (3.489) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 812 | 375 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (298) | (294) |
| | 514 | 81 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 29 | 159 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (224) | (684) |
| | (195) | (525) |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 603 | 702 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.820) | (2.431) |
| | (1.217) | (1.729) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61 | 316 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (100) | (289) |
| | (39) | 27 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Global Real Return Fund (Forts.) | |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 12 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | (22) |
| | (2) | (10) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (33) | (26) |
| | (33) | (26) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.157 | 1.181 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.045) | (3.866) |
| | (1.888) | (2.685) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 41.560 | 42.734 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (45.925) | (47.436) |
| | (4.365) | (4.702) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 622 | 1.298 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.260) | (3.040) |
| | (636) | (1.739) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 23.158 | 10.359 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.898) | (33.276) |
| | 13.260 | (22.917) |
| Class E GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 148 | 243 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (156) | (1.770) |
| | (7) | (1.526) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 553 | 335 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (383) | (342) |
| | 170 | (7) |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14 | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (118) | (261) |
| | (104) | (223) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 52 | 81 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (119) | (114) |
| | (67) | (33) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Global Real Return Fund (Forts.)** | | |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 419 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | (5) |
| | 410 | (5) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 20 | 2 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (35) | (181) |
| | (15) | (179) |
| Class S: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.279 | 1.618 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.178) | (315) |
| | 101 | 1.303 |
| Class S CHF (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 751 | 2.374 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.180) | (516) |
| | (429) | 1.858 |
| Class S EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.408 | 4.949 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.231) | (781) |
| | (823) | 4.168 |
| Class S GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.538 | 6.310 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.339) | (1.563) |
| | (801) | 4.747 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 25 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5) | - |
| | 20 | 1 |
| Class Z AUD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 171 | 1.726 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 18 | 22 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (580) | (440) |
| | (391) | 1.308 |
| **Income Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66.989 | 100.821 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (52.899) | (38.204) |
| | 14.090 | 62.617 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 19.032 | 85.736 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2.053 | 2.534 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.723) | (36.076) |
| | 10.362 | 52.194 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.428 | 51 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (137) | - |
| | 1.291 | 51 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.662 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1.662 | - |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66.870 | 65.385 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (32.812) | (25.178) |
| | 34.058 | 40.207 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.832 | 16.000 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 177 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.210) | (30.421) |
| | 13.629 | (14.244) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.862 | 18.655 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 515 | 249 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.261) | (2.248) |
| | 5.116 | 16.656 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.565 | 1.926 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 23 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.400) | (1.985) |
| | (3.812) | (53) |
| Institutional HKD (Unhedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 8 | - |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 5.379 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.108) | (1.271) |
| | (4.108) | 4.108 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 1.287 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.287) | - |
| | (1.286) | 1.287 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.985 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (187) | - |
| | 1.798 | - |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18.284 | 14.863 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 174 | 93 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.101) | (3.579) |
| | 14.357 | 11.377 |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 172 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (38) | - |
| | 134 | - |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15.515 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (225) | - |
| | 15.290 | - |
| Ausschüttende A-Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 200 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 200 | - |
| Administrative Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 68.373 | 17.176 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 344 | 245 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.158) | (8.041) |
| | 55.559 | 9.380 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 203 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (43) | - |
| | 160 | - |
| Administrative SGD (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9.704 | 4.121 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 32 | 29 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.235) | (6.973) |
| | 5.501 | (2.823) |
| Class E: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 68.121 | 59.780 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (27.052) | (22.545) |
| | 41.069 | 37.235 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 143.227 | 92.955 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 272 | 150 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (52.166) | (64.723) |
| | 91.333 | 28.382 |
| Class E CHF (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.228 | 1.466 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (715) | (263) |
| | 1.513 | 1.203 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Income Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.235 | 3.386 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.673) | (248) |
| | 1.562 | 3.138 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 62.987 | 72.302 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (39.680) | (11.992) |
| | 23.307 | 60.310 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 53.549 | 48.068 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (20.858) | (16.924) |
| | 32.693 | 31.145 |
| Class E HKD (Unhedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 22.446 | 21.717 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 10 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.878) | (30.739) |
| | 14.578 | (9.019) |
| Class E RMB (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 674 | 2.062 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.988) | (692) |
| | (1.312) | 1.371 |
| Class E SGD (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11.413 | 20.293 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 34 | 25 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.658) | (4.057) |
| | 7.789 | 16.261 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 60 | 23 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (11) | - |
| | 49 | 23 |
| Class R: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 92 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 92 | - |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.719 | 241 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (43) | (188) |
| | 1.676 | 53 |
| Class S EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 121 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8) | - |
| | 113 | - |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.548 | 2 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (84) | - |
| | 1.464 | 2 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 908 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (91) | - |
| | 818 | 1 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.158 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (63) | - |
| | 1.095 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.341 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (40) | - |
| | 1.301 | 1 |
| Class Z: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 485 | 23.684 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.792) | (14.370) |
| | (2.307) | 9.314 |
| Class Z AUD (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 35 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 35 | - |
| **Inflation Strategy Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.023 | 786 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.978) | (279) |
| | (1.955) | 507 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 912 | 44 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (680) | (41) |
| | 232 | 3 |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 184 | 406 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (98) | (30) |
| | 86 | 376 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Inflation Strategy Fund (Forts.)** | | |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 172 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (172) |
| | 1 | - |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 529 | 374 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (293) | (128) |
| | 236 | 246 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 152 | 287 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (163) | (35) |
| | (11) | 252 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 454 | 419 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (261) | (81) |
| | 193 | 338 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 402 | 379 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (114) | (80) |
| | 288 | 299 |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 22.369 | 55.917 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31.440) | (74.724) |
| | (9.071) | (18.807) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15.211 | 7.914 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 190 | 179 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.629) | (26.308) |
| | 772 | (18.215) |
| Institutional AUD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.000 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1.000 | - |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.925 | 22.668 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24.463) | (43.717) |
| | 2.462 | (21.049) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 694 | 4.051 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 49 | 150 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.166) | (25.029) |
| | (7.423) | (20.828) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Low Average Duration Fund (Forts.) | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (24.936) |
| | - | (24.936) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.620 | 2.808 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 20 | 15 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.807) | (1.229) |
| | (13.167) | 1.594 |
| Institutional ILS (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | 206 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (352) | (1.600) |
| | (349) | (1.394) |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.142 | 3.840 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.452) | (10.040) |
| | (2.310) | (6.200) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 79 | 595 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 6 | 10 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (874) | (1.311) |
| | (789) | (706) |
| Investor GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 98 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14) | (415) |
| | (14) | (317) |
| Administrative Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 344 | 3.380 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (288) | (11.281) |
| | 56 | (7.901) |
| Class E: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11.302 | 6.546 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.176) | (11.884) |
| | (3.874) | (5.338) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.136 | 3.763 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.778) | (5.058) |
| | 362 | (1.289) |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.310 | 8.984 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12.332) | (48.796) |
| | (2.022) | (39.812) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Low Average Duration Fund (Forts.) | |
| Class H Institutional: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 927 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (588) | (670) |
| | 339 | (670) |
| Class R: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 234 | 203 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (92) | (197) |
| | 142 | 6 |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 132 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (39) |
| | 132 | (39) |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 9 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | (36) |
| | (4) | (27) |
| | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.101 | 209 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (205) | - |
| | 4.896 | 209 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 188 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (99) |
| | - | 89 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.357 | 72 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (108) | - |
| | 1.249 | 72 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)** | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 795 | 58 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (199) | - |
| | 596 | 58 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 3 | 1 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 70 | 51 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (46) | (7) |
| | 24 | 44 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 306 | 265 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (112) | (18) |
| | 194 | 247 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 599 | 299 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (510) | - |
| | 89 | 299 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.755 | 7.884 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.286) | - |
| | 1.473 | 7.884 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 66 | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 66 | 38 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 152 | 38 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17) | - |
| | 138 | 38 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 79 | 30 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 77 | 30 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)** | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 347 | 30 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 13 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5) | - |
| | 355 | 30 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 5 | 1 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.) | |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund |
|---|---|
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 993 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 993 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class E EUR (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class R GBP (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class T: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 |
|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.) |
| Class T EUR (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |

| | PIMCO RAE Fundamental Europe Fund |
|---|---|
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.100 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.065) |
| | 3.035 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Institutional USD (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class E USD (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class R GBP (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class T: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class T USD (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 993 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 993 | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | |
| | 16 | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 4 | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 2 | |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class T EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 445 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (124) | (739) |
| | (123) | (294) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund (Forts.) | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.948 | 7.960 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.400) | (2.309) |
| | (3.452) | 5.651 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 420 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (3.176) |
| | (1) | (2.756) |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 6 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | (2) |
| | (1) | 4 |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 5 | - |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 104 | 242 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (83) | (10.397) |
| | 21 | (10.155) |
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 417 | 71 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (506) | (11) |
| | (89) | 60 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 15 | 20 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | 5 | 20 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.954 | 38.085 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.470) | (22.778) |
| | 1.484 | 15.307 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.750 | 18.212 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 280 | 87 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.262) | (922) |
| | (3.232) | 17.377 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.) | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 13 | 22.867 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (78) | (22.799) |
| | (65) | 68 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 12.093 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (14.918) |
| | - | (2.825) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 17.962 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (17.962) |
| | - | - |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11 | 31 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (33) | (4) |
| | (22) | 27 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | - |
| | - | 1 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 23.201 | 61.203 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31.166) | (4.735) |
| | (7.965) | 56.468 |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 104 | 39.332 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (54) | (49.520) |
| | 50 | (10.188) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.) | |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 23 | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14) | - |
| | 9 | 4 |
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.926 | 9.685 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.824) | (4) |
| | 1.102 | 9.681 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 68 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | - |
| | 64 | - |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.048 | 20.486 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17.989) | (4.745) |
| | (14.941) | 15.741 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.543 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 25 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (220) | - |
| | 1.348 | - |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 13.800 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15) | (13.793) |
| | (6) | 7 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 37 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (38) | - |
| | (1) | 1 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 7 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 2 | 1 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.204 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (690) | - |
| | 4.514 | 1 |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | 10 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | (9) |
| | 2 | 1 |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 4 | - |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1 |

| | PIMCO RAE Fundamental US Fund |
|---|---|
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.328 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1.328 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental US Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class E EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class R GBP (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class T EUR (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |

| | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 366 | 2.345 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (71) | (3.065) |
| | 295 | (720) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.823 | 4.440 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.473) | (1.712) |
| | 1.350 | 2.728 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.543) | - |
| | (1.543) | 1 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 365 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (102) | (180) |
| | (100) | 185 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | |
| Investor NOK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7 | 71 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12) | (9) |
| | (5) | 62 |
| Investor SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.916 | 308 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.892) | (303) |
| | 24 | 5 |
| **StocksPLUS™ Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 21.369 | 27.728 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.465) | (2.718) |
| | 7.904 | 25.010 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 6.855 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 8 | 29 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (180) | (9.267) |
| | (163) | (2.383) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.528 | 18.329 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.700) | (13.738) |
| | (3.172) | 4.591 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 135 | 12.769 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 14 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (61) | (12.532) |
| | 74 | 251 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 911 | 7.865 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 35 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.822) | (991) |
| | (6.909) | 6.909 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18 | 136 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (69) | (6) |
| | (51) | 130 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.754 | 2.643 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.394) | (2.088) |
| | 360 | 555 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11.248 | 23.041 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (28.148) | (6.141) |
| | (16.900) | 16.900 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **StocksPLUS™ Fund (Forts.)** | | |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1) |
| | - | (1) |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 9 | 1 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 846 | 3.120 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 58 | 47 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (897) |
| | 904 | 2.270 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 385 | 46 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (390) | - |
| | (5) | 46 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 5 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 13 | 3 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.814 | 360 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (674) | - |
| | 5.140 | 360 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 4 | 4 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 4 | 4 |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.405 | 906 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (525) | (34) |
| | 880 | 872 |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 579 | 507 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (272) | - |
| | 307 | 507 |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.571 | 1.972 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (870) | (62) |
| | 2.701 | 1.910 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Strategic Income Fund (Forts.)** | | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.917 | 1.691 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (700) | (48) |
| | 1.217 | 1.643 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | 1 | - |
| Class T EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 64 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8) | - |
| | 56 | 1 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 61 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6) | - |
| | 55 | 1 |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 16.868 | 39.355 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (32.827) | (97.471) |
| | (15.959) | (58.116) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 3.916 | 5.228 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 228 | 362 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17.668) | (26.446) |
| | (13.524) | (20.856) |
| Institutional CAD (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.044 | 6.518 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (19.694) | (138) |
| | (18.650) | 6.380 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 218 | 664 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (372) | (1.870) |
| | (154) | (1.206) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.471 | 18.038 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.936) | (53.615) |
| | (11.465) | (35.577) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.081 | 4.989 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 106 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.373) | (3.306) |
| | 2.814 | 1.689 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (41) | (2.560) |
| | (41) | (2.560) |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.832 | 3.317 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.326) | (3.261) |
| | 506 | 56 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 835 | 353 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (690) | (1.084) |
| | 145 | (731) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 805 | 2.820 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 34 | 54 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.392) | (9.458) |
| | (3.553) | (6.584) |
| Institutional ILS (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 196 | 1.154 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (110) | (9.018) |
| | 86 | (7.864) |
| Institutional JPY (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1.549 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | - |
| | - | 1.549 |
| Institutional SGD (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 17 | 301 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (406) | (2.010) |
| | (389) | (1.709) |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.770 | 6.941 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.763) | (54.583) |
| | (3.993) | (47.642) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.506 | 2.248 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 12 | 21 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.335) | (12.367) |
| | (2.817) | (10.098) |
| Investor CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 264 | 333 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (269) | (4.232) |
| | (5) | (3.899) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Total Return Bond Fund (Forts.) | |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.463 | 1.791 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.338) | (11.822) |
| | (1.875) | (10.031) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | 36 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4) | (44) |
| | - | (8) |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 75 | 173 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (60) | (1.492) |
| | 15 | (1.319) |
| Investor SGD (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (50) | (42) |
| | (50) | (42) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.898 | 5.683 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (8.764) | (20.474) |
| | (6.866) | (14.791) |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 86 | 89 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (172) | (953) |
| | (86) | (864) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.594 | 15.874 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (21.499) | (64.061) |
| | (13.905) | (48.187) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.294 | 7.188 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 143 | 171 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.712) | (45.295) |
| | (10.275) | (37.936) |
| Class E CHF (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 57 | 186 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (352) | (3.176) |
| | (295) | (2.990) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.680 | 9.388 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (41.983) | (120.218) |
| | (35.303) | (110.830) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Total Return Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.284 | 3.217 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.575) | (28.117) |
| | (9.291) | (24.900) |
| Class E HKD (Unhedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 50 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (165) | (361) |
| | (165) | (311) |
| Class E SGD (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 329 | 568 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (939) | (2.885) |
| | (610) | (2.317) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 171 | 48 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 1 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (233) | (1.050) |
| | (62) | (1.001) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 1 | 1 |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (17) | (23) |
| | (16) | (23) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11.206 | 7.153 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.298) | (19.128) |
| | 908 | (11.975) |
| Class M Retail HKD (Unhedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 100 | 799 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.578) | (694) |
| | (1.478) | 105 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 69 | 518 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (481) | (1.106) |
| | (412) | (588) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 30 | 296 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (33) | (573) |
| | (3) | (277) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Total Return Bond Fund (Forts.) | |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 134 | 344 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (69) | (140) |
| | 65 | 204 |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | 341 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (47) | (581) |
| | (42) | (240) |
| Class S: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.978 | 9.557 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.557) | (48.812) |
| | 1.421 | (39.255) |
| Class S EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 120 | 463 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (52) | (2.543) |
| | 68 | (2.080) |
| Class T: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 168 | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | - |
| | 166 | 5 |
| Class T EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 62 | 3 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22) | - |
| | 40 | 3 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 51 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (6.318) |
| | - | (6.266) |

| | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund |
|---|---|
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 334 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (115) |
| | 219 |
| Ausschüttende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 |
|---|---|
| | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 12 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.281 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (480) |
| | 1.801 |
| Ausschüttende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 4 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | |
| Ausschüttende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 5 |
| Investor Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Ausschüttende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 4 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Ausschüttende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 1 |
| Class E CHF (Hedged): | |
| Thesaurierende Anteile | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - |
| | 12 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)** | |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 4 | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 4 | |
| Class E GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 5 | |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 4 | |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 5 | |

| | | |
|---|---|---|
| | **UK Corporate Bond Fund** | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 842 | 6.190 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.769) | (12.405) |
| | (3.927) | (6.215) |

| | | |
|---|---|---|
| | **UK Long Term Corporate Bond Fund** | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.057 | 194 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.958) | (12.452) |
| | (6.901) | (12.258) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 638 | 1.904 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.140) | (3.495) |
| | (13.502) | (1.591) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | **UK Low Duration Fund** | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.258 | 8.089 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.477) | (3.769) |
| | (219) | (4.320) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11 | 1.567 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 7 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.083) | (154) |
| | (1.069) | 1.420 |

| | | |
|---|---|---|
| | **UK Real Return Fund** | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 100 | 16 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.257) | (506) |
| | (1.157) | (490) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 6 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (829) |
| | - | (823) |
| Class E: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 53 | 73 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (216) | (80) |
| | (163) | (7) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 109 | 272 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (329) | (98) |
| | (220) | 174 |

| | | |
|---|---|---|
| | **UK Sterling Long Average Duration Fund** | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 83 | 10 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (272) | (550) |
| | (189) | (540) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3) | (62) |
| | 2 | (62) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 45 | 51 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (64) | (74) |
| | (19) | (23) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 24.862 | 47.793 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (73.812) | (123.563) |
| | (48.950) | (75.770) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 681 | 1.525 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 76 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.191) | (11.159) |
| | (3.507) | (9.558) |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 103 | 317 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (644) | (6.244) |
| | (541) | (5.927) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.583 | 59.120 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (40.484) | (116.214) |
| | (29.901) | (57.094) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 271 | 13.712 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 2 | 85 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.059) | (27.278) |
| | (4.786) | (13.481) |
| Income II Shares | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 10.555 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 34 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (10.589) |
| | - | - |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.153 | 19.895 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (14.678) | (73.167) |
| | (9.525) | (53.272) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.100 | 4.345 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 17 | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (857) | (7.609) |
| | 260 | (3.264) |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.417 | 3.608 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (793) | (15.262) |
| | 25.624 | (11.654) |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 893 | 1.791 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (523) | (751) |
| | 370 | 1.040 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund (Forts.) | |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.026 | 5.501 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.865) | (22.844) |
| | (4.839) | (17.343) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 609 | 1.567 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 5 | 3 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.348) | (8.788) |
| | (3.734) | (7.218) |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 5 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15) | (708) |
| | (15) | (703) |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 165 | 681 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (985) | (5.742) |
| | (820) | (5.061) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 18 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (42) | (660) |
| | (42) | (642) |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (31) | (287) |
| | (31) | (283) |
| Administrative Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 99 | 2.435 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.911) | (11.295) |
| | (1.812) | (8.860) |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 388 | 858 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (873) | (7.499) |
| | (485) | (6.641) |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.825 | 3.278 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.087) | (18.220) |
| | (10.262) | (14.942) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.438 | 8.846 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13.441) | (65.258) |
| | (11.003) | (56.412) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 838 | 1.974 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 5 | 6 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.869) | (14.025) |
| | (4.026) | (12.045) |
| Class E CHF (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 35 | 1.894 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.844) | (28.958) |
| | (3.809) | (27.064) |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.179 | 40.686 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (22.027) | (124.933) |
| | (17.848) | (84.247) |
| Class E GBP (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 147 | 208 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (533) | (3.977) |
| | (386) | (3.769) |
| Class E SGD (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 27 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (43) | (782) |
| | (43) | (755) |
| Class G Institutional EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 9 | 4 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10) | - |
| | (1) | 4 |
| Class G Retail EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 439 | 919 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.770) | (9.073) |
| | (4.331) | (8.154) |
| Class H Institutional: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | (1) | - |
| Class R: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.252 | 122 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (371) | (150) |
| | 881 | (28) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 15 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9) | (74) |
| | (9) | (59) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund (Forts.) | |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 192 | 214 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (159) | (200) |
| | 33 | 14 |
| Class R GBP (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 65 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24) | (173) |
| | (24) | (108) |
| Class S: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14 | 2.841 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (5.329) |
| | 14 | (2.488) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 1.001 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (1.001) |
| | - | - |
| Class S CHF (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18 | 8 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (13) | (1.359) |
| | 5 | (1.351) |
| Class S EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | 884 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (66) | (5.634) |
| | (66) | (4.750) |
| Class T: Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 22 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1) | - |
| | 21 | 1 |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | - | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | 174 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (5.753) | (12.658) |
| | (5.753) | (12.484) |
| Class Z AUD (Hedged): Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.478 | 4.593 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 151 | 58 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.053) | (94) |
| | 576 | 4.557 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | US High Yield Bond Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 18.397 | 7.487 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.831) | (16.300) |
| | 7.566 | (8.813) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14.204 | 16.200 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 15 | 11 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (9.802) | (9.697) |
| | 4.417 | 6.514 |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 25 | 67 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | (105) |
| | 25 | (38) |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.586 | 3.543 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.376) | (5.285) |
| | 4.210 | (1.742) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 2.874 | 1.479 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 334 | 476 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2.340) | (2.864) |
| | 868 | (909) |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 7.260 | 11.846 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.429) | (10.665) |
| | 2.831 | 1.181 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1.420 | 1.949 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (3.292) | (4.261) |
| | (1.872) | (2.312) |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 280 | 728 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 10 | 17 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.911) | (4.395) |
| | (1.621) | (3.650) |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 127 | 68 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (266) | (603) |
| | (139) | (535) |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6.815 | 9.933 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (6.673) | (10.872) |
| | 142 | (939) |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | US High Yield Bond Fund (Forts.) | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 14.851 | 10.425 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 87 | 44 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (15.519) | (16.814) |
| | (581) | (6.345) |
| Class E EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 620 | 762 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.254) | (1.798) |
| | (634) | (1.036) |
| Class H Institutional: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 12.481 | 12.391 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (12.630) | (12.289) |
| | (149) | 102 |
| Class M Retail: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 5.944 | 10.160 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 3 | 14 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (7.847) | (9.758) |
| | (1.900) | 416 |
| Class R: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 11 | 150 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (39) | (3) |
| | (28) | 147 |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 92 | 200 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (24) | (522) |
| | 68 | (322) |
| Class R EUR (Hedged): | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 6 | - |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (2) | (29) |
| | 4 | (29) |
| Class R GBP (Hedged): | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 42 | 8 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (109) | (28) |
| | (67) | (20) |
| | US Short-Term Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 26.555 | 2.548 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.476) | (204) |
| | 22.079 | 2.344 |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 4.782 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (1.099) | - |
| | 3.683 | 1 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | US Short-Term Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 386 | 1 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | - |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (64) | - |
| | 322 | 1 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 8.051 | 35.978 |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 479 | 140 |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (10.215) | - |
| | (1.685) | 36.118 |
| | US Small Cap StocksPLUS™ Fund | |
| Institutional Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 10.299 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | (4.943) | |
| | 5.356 | |
| Investor Class: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | | |
| Ausgegeben und aufgerechnet | 1 | |
| Emissionen aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | - | |
| Rücknahmen während des Berichtszeitraums | - | |
| | 1 | |

## 17. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert je Anteil der vergangenen drei Jahre (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO Asia Local Bond Fund | | |
| Nettovermögen | k. A. | $ 5.413 | $ 4.835 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 4.961 | $ 4.786 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 498 | 498 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,96 | $ 9,61 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 411 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 42 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,86 | $ 9,58 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 41 | $ 39 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4 | 4 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,68 | $ 9,52 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund | | |
| Nettovermögen | $ 6.120.004 | $ 4.502.515 | $ 706.888 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.009.512 | $ 368.039 | $ 80.449 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 67.574 | 25.592 | 5.934 |
| NIW je Anteil | $ 14,94 | $ 14,38 | $ 13,56 |
| Ausschüttende Anteile | $ 133.622 | $ 50.580 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.559 | 5.113 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,85 | $ 9,89 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 117.642 | CHF 7.982 | CHF 1.263 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.625 | 601 | 101 |
| NIW je Anteil | CHF 13,64 | CHF 13,28 | CHF 12,55 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.054.954 | € 950.027 | € 102.678 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 87.943 | 82.008 | 9.396 |
| NIW je Anteil | € 12,00 | € 11,58 | € 10,93 |
| Ausschüttende Anteile | € 270.989 | € 57.344 | € 652 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.603 | 4.747 | 55 |
| NIW je Anteil | € 11,99 | € 12,08 | € 11,84 |
| Income II Shares | € 154.113 | € 204.731 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.012 | 20.941 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,63 | € 9,78 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 61.822 | £ 23.965 | £ 1.297 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.258 | 2.122 | 123 |
| NIW je Anteil | £ 11,76 | £ 11,30 | £ 10,62 |
| Ausschüttende Anteile | £ 120.736 | £ 88.633 | £ 73.233 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.971 | 7.304 | 6.176 |
| NIW je Anteil | £ 12,11 | £ 12,13 | £ 11,86 |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | |
| Income II Shares | SGD 15 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 9,89 | k. A. | k. A. |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 12.066 | $ 5.098 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.159 | 507 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,41 | $ 10,06 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 5.606 | $ 456 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 572 | 46 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,80 | $ 9,84 | k. A. |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 259.507 | $ 200.876 | $ 32.870 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.636 | 14.110 | 2.437 |
| NIW je Anteil | $ 14,71 | $ 14,24 | $ 13,49 |
| Ausschüttende Anteile | $ 243.875 | $ 192.593 | $ 8.233 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.416 | 14.487 | 632 |
| NIW je Anteil | $ 13,24 | $ 13,29 | $ 13,02 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)** | | | |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 64.839 | € 39.919 | € 3.059 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.446 | 2.820 | 228 |
| NIW je Anteil | € 14,58 | € 14,16 | € 13,41 |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK 13.560 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 134 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 101,14 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 449.938 | $ 252.007 | $ 244 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 40.475 | 23.337 | 24 |
| NIW je Anteil | $ 11,12 | $ 10,80 | $ 10,27 |
| Ausschüttende Anteile | $ 75.050 | $ 19.109 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.649 | 1.940 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,81 | $ 9,85 | k. A. |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 10.829 | CHF 3.894 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.081 | 396 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,02 | CHF 9,84 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 925.754 | € 851.309 | € 1.416 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 83.572 | 78.867 | 138 |
| NIW je Anteil | € 11,08 | € 10,79 | € 10,27 |
| Ausschüttende Anteile | € 2.211 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 224 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,87 | k. A. | k. A. |
| Class M Retail: | | | |
| Income II Shares | $ 332.997 | $ 189.654 | $ 1.010 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.863 | 18.877 | 101 |
| NIW je Anteil | $ 9,83 | $ 10,05 | $ 10,01 |
| Class M Retail SGD (Hedged): | | | |
| Income II Shares | SGD 65.194 | SGD 59.540 | SGD 313 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.586 | 5.933 | 31 |
| NIW je Anteil | SGD 9,90 | SGD 10,03 | SGD 10,01 |
| Class R: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 23.536 | $ 31.919 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.377 | 3.210 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,90 | $ 9,94 | k. A. |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 3.522 | € 911 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 366 | 94 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,61 | € 9,68 | k. A. |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 5.179 | £ 411 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 535 | 42 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,68 | £ 9,71 | k. A. |
| Class S: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 3.190 | $ 1.356 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 319 | 135 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,01 | $ 10,05 | k. A. |
| Class S CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 502 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 50 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,95 | k. A. | k. A. |
| Class S EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 13.474 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.346 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,01 | k. A. | k. A. |
| Class T: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.375 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 235 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,11 | $ 10,15 | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)** | | | |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 5.437 | € 18 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 528 | 2 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,30 | € 10,08 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 403.858 | $ 411.465 | $ 310.416 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 37.266 | 37.815 | 29.121 |
| NIW je Anteil | $ 10,84 | $ 10,88 | $ 10,66 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD 1.527 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 156 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 9,82 | k. A. | k. A. |
| **Commodity Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 350.360 | $ 298.408 | $ 528.288 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 202.860 | $ 148.196 | $ 107.685 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.512 | 19.405 | 11.684 |
| NIW je Anteil | $ 5,71 | $ 7,64 | $ 9,22 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 53.902 | € 46.738 | € 133.576 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.350 | 5.355 | 12.602 |
| NIW je Anteil | € 6,46 | € 8,73 | € 10,60 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 98.741 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 9.941 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,93 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 269 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 34 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 7,95 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 4.831 | $ 5.520 | $ 3.851 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 957 | 816 | 470 |
| NIW je Anteil | $ 5,05 | $ 6,77 | $ 8,19 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 68.876 | $ 77.515 | $ 81.930 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.160 | 11.815 | 10.257 |
| NIW je Anteil | $ 4,86 | $ 6,56 | $ 7,99 |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.800 | $ 3.441 | $ 7.705 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 822 | 744 | 1.368 |
| NIW je Anteil | $ 3,40 | $ 4,63 | $ 5,63 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 11.420 | € 5.712 | € 4.676 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.171 | 796 | 532 |
| NIW je Anteil | € 5,26 | € 7,18 | € 8,79 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 25 | $ 257 | $ 97 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 35 | 11 |
| NIW je Anteil | $ 5,46 | $ 7,31 | $ 8,83 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 9 | $ 12 | $ 14 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 6,55 | $ 8,85 | $ 10,76 |
| **PIMCO Credit Absolute Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 999.334 | $ 1.682.122 | $ 1.632.332 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 61.615 | $ 108.489 | $ 127.642 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.617 | 9.563 | 11.407 |
| NIW je Anteil | $ 10,97 | $ 11,35 | $ 11,19 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Credit Absolute Return Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 16.333 | CHF 18.476 | CHF 28.191 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.677 | 1.812 | 2.797 |
| NIW je Anteil | CHF 9,74 | CHF 10,19 | CHF 10,08 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 243.702 | € 484.820 | € 403.476 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.375 | 42.882 | 36.188 |
| NIW je Anteil | € 10,89 | € 11,31 | € 11,15 |
| Income II Shares | € 257.843 | € 338.098 | € 174.830 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 28.004 | 34.023 | 17.374 |
| NIW je Anteil | € 9,21 | € 9,94 | € 10,06 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 448 | £ 1.366 | £ 3.324 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 40 | 119 | 296 |
| NIW je Anteil | £ 11,07 | £ 11,43 | £ 11,24 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 11.031 | $ 18.208 | $ 16.497 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.135 | 1.802 | 1.647 |
| NIW je Anteil | $ 9,72 | $ 10,10 | $ 10,01 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.276 | € 1.350 | € 1.141 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 132 | 134 | 114 |
| NIW je Anteil | € 9,66 | € 10,07 | € 9,98 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10.326 | $ 12.634 | $ 15.762 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.070 | 1.255 | 1.573 |
| NIW je Anteil | $ 9,65 | $ 10,07 | $ 10,02 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 324.977 | € 433.473 | € 462.494 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.855 | 43.112 | 46.191 |
| NIW je Anteil | € 9,60 | € 10,05 | € 10,00 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 49 | € 53 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 5 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,51 | € 10,02 | k. A. |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 29 | £ 40 | £ 50 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 4 | 5 |
| NIW je Anteil | £ 9,52 | £ 10,10 | £ 10,09 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 50 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,39 | € 9,86 | k. A. |
| **Diversified Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 5.709.944 | $ 7.483.173 | $ 12.507.776 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 205.125 | $ 239.353 | $ 301.814 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.778 | 12.498 | 16.392 |
| NIW je Anteil | $ 19,03 | $ 19,15 | $ 18,41 |
| Ausschüttende Anteile | $ 82.181 | $ 123.393 | $ 126.570 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.138 | 8.761 | 8.957 |
| NIW je Anteil | $ 13,39 | $ 14,08 | $ 14,13 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Diversified Income Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CAD 33.356 | CAD 34.791 | CAD 32.327 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.710 | 2.818 | 2.745 |
| NIW je Anteil | CAD 12,31 | CAD 12,35 | CAD 11,78 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 10.356 | CHF 13.162 | CHF 12.745 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 898 | 1.118 | 1.123 |
| NIW je Anteil | CHF 11,53 | CHF 11,77 | CHF 11,35 |
| Ausschüttende Anteile | CHF 6.047 | CHF 6.399 | CHF 165.651 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 667 | 661 | 16.998 |
| NIW je Anteil | CHF 9,07 | CHF 9,67 | CHF 9,75 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 663.985 | € 683.842 | € 521.052 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 46.379 | 47.294 | 37.429 |
| NIW je Anteil | € 14,32 | € 14,46 | € 13,92 |
| Ausschüttende Anteile | € 363.472 | € 550.691 | € 2.830.504 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.196 | 54.779 | 279.838 |
| NIW je Anteil | € 9,52 | € 10,05 | € 10,11 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 5.424 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 540 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,05 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 845.234 | £ 991.631 | £ 564.341 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 75.806 | 88.452 | 52.482 |
| NIW je Anteil | £ 11,15 | £ 11,21 | £ 10,75 |
| Ausschüttende Anteile | £ 264.824 | £ 285.127 | £ 404.328 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.145 | 40.079 | 56.754 |
| NIW je Anteil | £ 6,77 | £ 7,11 | £ 7,12 |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK 511.387 | SEK 468.590 | SEK 423.040 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.455 | 3.131 | 2.949 |
| NIW je Anteil | SEK 148,02 | SEK 149,68 | SEK 143,46 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9.701 | $ 10.639 | $ 4.311 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 981 | 1.066 | 447 |
| NIW je Anteil | $ 9,89 | $ 9,98 | $ 9,63 |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.473 | $ 123 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 163 | 13 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,03 | $ 9,50 | $ 9,50 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 3.026 | € 5.400 | € 41.371 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 218 | 383 | 3.039 |
| NIW je Anteil | € 13,90 | € 14,08 | € 13,61 |
| Ausschüttende Anteile | € 2.708 | € 5.481 | € 4.920 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 301 | 577 | 515 |
| NIW je Anteil | € 8,99 | € 9,49 | € 9,55 |
| Administrative Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 13.149 | $ 15.842 | $ 17.938 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.331 | 1.524 | 1.721 |
| NIW je Anteil | $ 9,88 | $ 10,39 | $ 10,42 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9.899 | € 6.467 | € 16.747 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 721 | 464 | 1.242 |
| NIW je Anteil | € 13,72 | € 13,93 | € 13,48 |
| Ausschüttende Anteile | € 1.463 | € 2.670 | € 4.361 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 148 | 256 | 416 |
| NIW je Anteil | € 9,87 | € 10,43 | € 10,49 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 2.132 | £ 1.178 | £ 2.699 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 215 | 113 | 259 |
| NIW je Anteil | £ 9,90 | £ 10,41 | £ 10,42 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 294.090 | $ 335.207 | $ 457.190 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.844 | 18.909 | 26.584 |
| NIW je Anteil | $ 17,46 | $ 17,73 | $ 17,20 |
| Ausschüttende Anteile | $ 473.847 | $ 554.277 | $ 757.431 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.647 | 44.096 | 60.056 |
| NIW je Anteil | $ 11,95 | $ 12,57 | $ 12,61 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 611.410 | € 797.472 | € 1.104.656 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 45.778 | 58.588 | 83.487 |
| NIW je Anteil | € 13,36 | € 13,61 | € 13,23 |
| Ausschüttende Anteile | € 735.684 | € 986.488 | € 1.418.692 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 67.843 | 86.133 | 123.127 |
| NIW je Anteil | € 10,84 | € 11,45 | € 11,52 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD 1.963 | SGD 3.660 | SGD 6.603 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 217 | 386 | 694 |
| NIW je Anteil | SGD 9,06 | SGD 9,47 | SGD 9,51 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 413 | € 257 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 43 | 25 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,70 | € 10,14 | k. A. |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 2.138 | € 2.521 | € 1.417 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 214 | 238 | 134 |
| NIW je Anteil | € 10,00 | € 10,59 | € 10,60 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 165.151 | $ 255.124 | $ 333.783 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.366 | 17.420 | 23.666 |
| NIW je Anteil | $ 14,53 | $ 14,65 | $ 14,10 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,57 | $ 9,47 |
| Class M Retail: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 91.412 | $ 141.259 | $ 386.757 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.943 | 13.145 | 35.876 |
| NIW je Anteil | $ 10,22 | $ 10,75 | $ 10,78 |
| Income II Shares | $ 15.248 | $ 6.318 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.661 | 645 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,18 | $ 9,80 | $ 9,99 |
| Class M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD 17.423 | AUD 15.508 | AUD 13.049 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.794 | 1.550 | 1.328 |
| NIW je Anteil | AUD 9,71 | AUD 10,01 | AUD 9,80 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 10,00 |
| Ausschüttende Anteile | $ 154 | $ 2.649 | $ 564 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17 | 275 | 58 |
| NIW je Anteil | $ 9,15 | $ 9,62 | $ 9,65 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 183 | € 237 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 18 | 24 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,32 | € 9,96 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 489 | £ 604 | £ 895 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53 | 63 | 93 |
| NIW je Anteil | £ 9,16 | £ 9,63 | £ 9,64 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Diversified Income Fund (Forts.) | | |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 280 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,68 | $ 9,88 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 260 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 28 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,38 | $ 9,84 | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.048 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 109 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,61 | € 9,84 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 747 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 80 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,29 | € 9,79 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 12 | $ 12 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 11,76 | $ 11,76 | $ 11,23 |
| | Diversified Income Duration Hedged Fund | | |
| Nettovermögen | $ 1.056.545 | $ 1.672.466 | $ 3.242.670 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 40.188 | $ 78.697 | $ 107.524 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.600 | 6.945 | 9.222 |
| NIW je Anteil | $ 11,16 | $ 11,33 | $ 11,66 |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,80 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 78.033 | € 141.550 | € 531.571 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.875 | 12.245 | 44.645 |
| NIW je Anteil | € 11,35 | € 11,56 | € 11,91 |
| Income II Shares | € 223.856 | € 339.099 | € 402.283 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.330 | 35.957 | 39.582 |
| NIW je Anteil | € 8,84 | € 9,43 | € 10,16 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 293.549 | £ 102.120 | £ 19.257 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.065 | 8.588 | 1.578 |
| NIW je Anteil | £ 11,71 | £ 11,89 | £ 12,21 |
| Ausschüttende Anteile | £ 26.035 | £ 37.944 | £ 27.157 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.927 | 4.042 | 2.713 |
| NIW je Anteil | £ 8,89 | £ 9,39 | £ 10,01 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 6.665 | $ 7.168 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 699 | 738 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,53 | $ 9,71 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.526 | $ 2.418 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 170 | 256 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,96 | $ 9,46 | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 29.830 | $ 54.923 | $ 17.959 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.082 | 5.538 | 1.744 |
| NIW je Anteil | $ 9,68 | $ 9,92 | $ 10,30 |
| Ausschüttende Anteile | $ 88.760 | $ 145.386 | $ 264.053 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.497 | 14.743 | 25.059 |
| NIW je Anteil | $ 9,35 | $ 9,86 | $ 10,54 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 65.945 | € 454.517 | € 1.068.522 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.960 | 39.959 | 90.408 |
| NIW je Anteil | € 11,07 | € 11,37 | € 11,82 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)** | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 13.663 | € | 23.697 | € | 8.116 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.567 | | 2.565 | | 821 |
| NIW je Anteil | € | 8,72 | € | 9,24 | € | 9,88 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD | 1.344 | SGD | 2.086 | SGD | 1.772 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 148 | | 220 | | 175 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,06 | SGD | 9,49 | SGD | 10,15 |
| Class R: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 2.921 | $ | 3.604 | $ | 4.491 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 323 | | 378 | | 441 |
| NIW je Anteil | $ | 9,03 | $ | 9,53 | $ | 10,18 |
| Class T: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 37 | $ | 10 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,52 | $ | 9,79 | | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 178 | € | 7 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 19 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,28 | € | 9,58 | | k. A. |
| Class Z: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 12 | $ | 12 | $ | 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 9,51 | $ | 9,99 | $ | 10,62 |
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund** | | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 110.062 | $ | 139.668 | $ | 157.014 |
| Institutional Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 2.214 | $ | 1.832 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 236 | | 176 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,37 | $ | 10,40 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ | 6.609 | $ | 9.296 | $ | 4.490 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 600 | | 732 | | 354 |
| NIW je Anteil | $ | 11,02 | $ | 12,69 | $ | 12,68 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 489 | € | 78 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 49 | | 7 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 10,02 | € | 10,89 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € | 5.104 | € | 23.470 | € | 40.882 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 464 | | 1.892 | | 3.457 |
| NIW je Anteil | € | 10,99 | € | 12,41 | € | 11,82 |
| Investor Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 9 | $ | 10 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,31 | $ | 10,37 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ | 9 | $ | 10 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 8,72 | $ | 10,06 | | k. A. |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 2.607 | € | 2.229 | € | 213 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 265 | | 200 | | 20 |
| NIW je Anteil | € | 9,84 | € | 11,14 | € | 10,65 |
| Class E: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 6.347 | $ | 1.047 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 695 | | 102 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,13 | $ | 10,27 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ | 19.009 | $ | 28.682 | $ | 17.564 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.920 | | 2.482 | | 1.500 |
| NIW je Anteil | $ | 9,90 | $ | 11,56 | $ | 11,71 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund (Forts.)** | | | | | | |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 4.884 | CHF | 5.402 | CHF | 5.065 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 460 | | 459 | | 459 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,62 | CHF | 11,77 | CHF | 11,04 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 11.515 | € | 11 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.181 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,75 | € | 10,75 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € | 43.561 | € | 50.690 | € | 52.559 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.121 | | 4.193 | | 4.509 |
| NIW je Anteil | € | 10,57 | € | 12,09 | € | 11,68 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 12 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,77 | | k. A. | | k. A. |
| Class R GBP (Unhedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 445 | £ | 486 | £ | 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 41 | | 41 | | 1 |
| NIW je Anteil | £ | 10,79 | £ | 11,79 | £ | 11,14 |
| Class T: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 91 | $ | 11 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 41 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,48 | $ | 10,71 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ | 110 | $ | 11 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,11 | $ | 10,66 | | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 36 | € | 8 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,31 | € | 10,29 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € | 944 | € | 8 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 106 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 8,93 | € | 10,24 | | k. A. |
| Class Z: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 13 | $ | 14 | $ | 14 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 11,31 | $ | 12,90 | $ | 12,77 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 54.568 | $ | 91.896 | $ | 501.485 |
| Institutional Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 210 | $ | 5.843 | $ | 12.406 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 22 | | 585 | | 1.206 |
| NIW je Anteil | $ | 9,45 | $ | 9,98 | $ | 10,29 |
| Ausschüttende Anteile | | k. A. | $ | 10 | $ | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | | k. A. | $ | 8,31 | $ | 9,10 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 8.791 | € | 8.671 | € | 75.490 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 671 | | 698 | | 6.713 |
| NIW je Anteil | € | 13,10 | € | 12,42 | € | 11,24 |
| Income II Shares | | k. A. | | k. A. | € | 46.072 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | k. A. | | 4.738 |
| NIW je Anteil | | k. A. | | k. A. | € | 9,72 |
| Class E: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 27.876 | $ | 44.655 | $ | 66.787 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.279 | | 4.643 | | 6.289 |
| NIW je Anteil | $ | 8,50 | $ | 9,62 | $ | 10,62 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 2.004 | € | 2.167 | € | 148.091 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 164 | | 186 | | 13.894 |
| NIW je Anteil | € | 12,21 | € | 11,67 | € | 10,66 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Asia Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | HKD 114.361 | HKD 219.262 | HKD 394.199 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.556 | 26.346 | 42.804 |
| NIW je Anteil | HKD 7,35 | HKD 8,32 | HKD 9,19 |
| **Emerging Local Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.569.152 | $ 4.518.882 | $ 5.957.198 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 419.945 | $ 989.942 | $ 927.814 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 40.099 | 78.980 | 69.287 |
| NIW je Anteil | $ 10,47 | $ 12,53 | $ 13,39 |
| Ausschüttende Anteile | $ 655.073 | $ 914.404 | $ 1.377.900 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 89.534 | 99.216 | 133.869 |
| NIW je Anteil | $ 7,32 | $ 9,22 | $ 10,29 |
| Institutional CAD (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | CAD 410 | CAD 779 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 38 | 74 |
| NIW je Anteil | k. A. | CAD 10,79 | CAD 10,57 |
| Institutional CHF (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 91.491 | CHF 169.632 | CHF 89.650 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.852 | 18.497 | 10.223 |
| NIW je Anteil | CHF 7,72 | CHF 9,17 | CHF 8,77 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 374.216 | € 492.486 | € 621.821 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.188 | 43.100 | 58.010 |
| NIW je Anteil | € 10,63 | € 11,43 | € 10,72 |
| Ausschüttende Anteile | € 587.440 | € 764.749 | € 924.041 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 75.650 | 87.113 | 107.349 |
| NIW je Anteil | € 7,77 | € 8,78 | € 8,61 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 68.083 | £ 160.979 | £ 129.457 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.851 | 10.138 | 8.107 |
| NIW je Anteil | £ 14,03 | £ 15,88 | £ 15,97 |
| Ausschüttende Anteile | £ 503 | £ 1.201 | £ 1.401 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 50 | 101 | 112 |
| NIW je Anteil | £ 10,01 | £ 11,91 | £ 12,52 |
| Institutional ILS (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | ILS 22.257 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.350 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | ILS 9,47 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 20.625 | $ 33.803 | $ 82.151 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.550 | 3.479 | 7.888 |
| NIW je Anteil | $ 8,09 | $ 9,72 | $ 10,41 |
| Investor CHF (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 3.236 | CHF 8.427 | CHF 11.133 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 379 | 829 | 1.141 |
| NIW je Anteil | CHF 8,53 | CHF 10,17 | CHF 9,76 |
| Investor EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 4.185 | € 7.028 | € 13.685 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 417 | 649 | 1.343 |
| NIW je Anteil | € 10,04 | € 10,83 | € 10,19 |
| Administrative EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 205 | € 267 | € 1.328 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21 | 25 | 134 |
| NIW je Anteil | € 9,70 | € 10,48 | € 9,88 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Local Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 66.516 | $ 180.535 | $ 289.353 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.807 | 15.283 | 22.701 |
| NIW je Anteil | $ 9,77 | $ 11,81 | $ 12,75 |
| Ausschüttende Anteile | $ 19.688 | $ 31.814 | $ 41.570 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.873 | 3.687 | 4.315 |
| NIW je Anteil | $ 6,85 | $ 8,63 | $ 9,63 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 115.371 | € 301.985 | € 412.196 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.308 | 22.456 | 32.341 |
| NIW je Anteil | € 12,39 | € 13,45 | € 12,74 |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 164 | € 128 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17 | 12 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,60 | € 10,78 | k. A. |
| Class G Retail EUR (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 7.182 | € 21.519 | € 25.122 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 877 | 2.325 | 2.771 |
| NIW je Anteil | € 8,19 | € 9,25 | € 9,07 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 85 | $ 156 | $ 626 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12 | 18 | 69 |
| NIW je Anteil | $ 7,10 | $ 8,51 | $ 9,11 |
| Ausschüttende Anteile | $ 7 | $ 9 | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 6,27 | $ 7,86 | $ 8,78 |
| Class S CHF (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | CHF 6.328 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 677 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | CHF 9,35 |
| Class S EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | € 280 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 28 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,85 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 8.768 | $ 14.033 | $ 139.793 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 999 | 1.269 | 11.322 |
| NIW je Anteil | $ 8,77 | $ 11,06 | $ 12,35 |
| **Emerging Markets 2018 Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 51.530 | $ 30.064 | |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.151 | $ 1.043 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 114 | 107 | |
| NIW je Anteil | $ 10,12 | $ 9,75 | |
| Ausschüttende Anteile | $ 38.395 | $ 24.406 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.913 | 2.460 | |
| NIW je Anteil | $ 9,81 | $ 9,92 | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 930 | CHF 907 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 93 | 93 | |
| NIW je Anteil | CHF 9,99 | CHF 9,74 | |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 6.738 | € 980 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 669 | 101 | |
| NIW je Anteil | € 10,08 | € 9,74 | |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 998 | $ 965 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 99 | 99 | |
| NIW je Anteil | $ 10,08 | $ 9,74 | |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Emerging Markets 2018 Fund (Forts.) | | |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 380 | € 369 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38 | 38 | |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 9,73 | |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 52 | € 50 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 5 | |
| NIW je Anteil | € 10,01 | € 9,73 | |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 19 | $ 10 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 1 | |
| NIW je Anteil | $ 10,03 | $ 9,74 | |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 9 | CHF 9 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | CHF 9,90 | CHF 9,73 | |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.038 | € 37 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 104 | 4 | |
| NIW je Anteil | € 9,97 | € 9,72 | |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 146 | € 8 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15 | 1 | |
| NIW je Anteil | € 9,98 | € 9,73 | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 627 | £ 604 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 62 | 62 | |
| NIW je Anteil | £ 10,11 | £ 9,75 | |
| Class S: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10 | $ 10 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | $ 10,12 | $ 9,75 | |
| Class S CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 9 | CHF 9 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | CHF 9,99 | CHF 9,74 | |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 8 | € 8 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | € 9,93 | € 9,72 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 3.081.503 | $ 4.693.187 | $ 5.671.748 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 491.220 | $ 894.363 | $ 941.415 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.218 | 23.417 | 25.077 |
| NIW je Anteil | $ 37,16 | $ 38,19 | $ 37,54 |
| Ausschüttende Anteile | $ 614.377 | $ 643.921 | $ 595.125 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 36.571 | 35.343 | 31.576 |
| NIW je Anteil | $ 16,80 | $ 18,22 | $ 18,85 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | CHF 64.940 | CHF 623.948 | CHF 637.944 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.325 | 29.093 | 28.628 |
| NIW je Anteil | CHF 19,53 | CHF 21,45 | CHF 22,28 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 516.467 | € 487.570 | € 732.618 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.268 | 13.966 | 21.304 |
| NIW je Anteil | € 33,83 | € 34,91 | € 34,38 |
| Ausschüttende Anteile | € 881.604 | € 870.982 | € 828.522 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 97.536 | 88.431 | 81.094 |
| NIW je Anteil | € 9,04 | € 9,85 | € 10,22 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Emerging Markets Bond Fund (Forts.) | | |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 29.569 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.994 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,88 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 52.192 | £ 108.277 | £ 133.116 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.481 | 5.009 | 6.278 |
| NIW je Anteil | £ 21,04 | £ 21,62 | £ 21,21 |
| Ausschüttende Anteile | £ 4.662 | £ 6.198 | £ 4.632 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.073 | 1.315 | 951 |
| NIW je Anteil | £ 4,34 | £ 4,71 | £ 4,87 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 4.101 | $ 8.666 | $ 14.905 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 116 | 237 | 413 |
| NIW je Anteil | $ 35,44 | $ 36,55 | $ 36,05 |
| Ausschüttende Anteile | $ 4.147 | $ 6.831 | $ 8.416 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 377 | 573 | 683 |
| NIW je Anteil | $ 10,99 | $ 11,92 | $ 12,33 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 3.839 | € 4.951 | € 7.526 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 119 | 149 | 229 |
| NIW je Anteil | € 32,13 | € 33,28 | € 32,89 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | € 21.772 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.418 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,00 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 19.055 | $ 28.565 | $ 48.219 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 544 | 790 | 1.350 |
| NIW je Anteil | $ 35,00 | $ 36,16 | $ 35,71 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 49.009 | $ 81.127 | $ 146.834 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.436 | 2.293 | 4.184 |
| NIW je Anteil | $ 34,12 | $ 35,38 | $ 35,09 |
| Ausschüttende Anteile | $ 60.077 | $ 66.616 | $ 102.324 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.933 | 6.068 | 9.011 |
| NIW je Anteil | $ 10,13 | $ 10,98 | $ 11,36 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 104.641 | € 331.253 | € 325.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.374 | 10.257 | 10.136 |
| NIW je Anteil | € 31,01 | € 32,29 | € 32,09 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | SGD 4.302 | SGD 6.140 | SGD 9.696 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 87 | 120 | 191 |
| NIW je Anteil | SGD 49,66 | SGD 51,16 | SGD 50,80 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 12.392 | $ 31.289 | $ 56.074 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 338 | 829 | 1.509 |
| NIW je Anteil | $ 36,67 | $ 37,74 | $ 37,16 |
| Class M Retail: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 21.380 | $ 34.020 | $ 109.338 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.348 | 3.449 | 10.719 |
| NIW je Anteil | $ 9,11 | $ 9,86 | $ 10,20 |
| Income II Shares | $ 12.051 | $ 41.296 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.395 | 4.339 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 8,64 | $ 9,52 | $ 9,98 |
| Class M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD 2.300 | AUD 5.977 | AUD 6.204 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 270 | 659 | 675 |
| NIW je Anteil | AUD 8,53 | AUD 9,07 | AUD 9,17 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 622 | $ 1.027 | $ 1.124 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 67 | 107 | 119 |
| NIW je Anteil | $ 9,35 | $ 9,62 | $ 9,47 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 167 | $ 675 | $ 851 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21 | 77 | 94 |
| NIW je Anteil | $ 8,06 | $ 8,74 | $ 9,04 |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € 27 | € 142 | € 193 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 15 | 20 |
| NIW je Anteil | € 9,26 | € 9,57 | € 9,44 |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | £ 21 | £ 23 | £ 236 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 3 | 26 |
| NIW je Anteil | £ 8,08 | £ 8,76 | £ 9,04 |
| Class S: Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 6.453 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 686 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,41 | k. A. |
| Class Z: Thesaurierende Anteile | $ 11 | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,89 | $ 11,11 | $ 10,83 |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.886 | $ 5.088 | $ 7.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 259 | 420 | 581 |
| NIW je Anteil | $ 11,16 | $ 12,11 | $ 12,53 |
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 624.353 | $ 1.103.120 | $ 1.845.162 |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | $ 13.240 | $ 162.450 | $ 130.003 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.061 | 12.398 | 9.897 |
| NIW je Anteil | $ 12,48 | $ 13,10 | $ 13,14 |
| Ausschüttende Anteile | $ 332.982 | $ 300.001 | $ 262.220 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.297 | 31.201 | 26.052 |
| NIW je Anteil | $ 8,69 | $ 9,61 | $ 10,07 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | CHF 1.072 | CHF 7.598 | CHF 25.930 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 130 | 820 | 2.663 |
| NIW je Anteil | CHF 8,27 | CHF 9,27 | CHF 9,74 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € 103.969 | € 157.023 | € 303.339 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.660 | 12.407 | 23.896 |
| NIW je Anteil | € 12,01 | € 12,66 | € 12,69 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 29.362 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.919 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,06 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | £ 579 | £ 34.238 | £ 28.725 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 66 | 3.523 | 2.829 |
| NIW je Anteil | £ 8,79 | £ 9,72 | £ 10,15 |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | $ 44 | $ 145 | $ 146 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 15 | 15 |
| NIW je Anteil | $ 9,31 | $ 9,81 | $ 9,87 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 229 | $ 1.746 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 25 | 183 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,12 | $ 9,54 |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € 782 | € 1.067 | € 2.380 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 85 | 109 | 242 |
| NIW je Anteil | € 9,23 | € 9,76 | € 9,83 |
| Administrative Class: Ausschüttende Anteile | $ 2.769 | $ 3.710 | $ 8.973 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 325 | 393 | 909 |
| NIW je Anteil | $ 8,53 | $ 9,43 | $ 9,87 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ 28.000 | $ 63.188 | $ 123.606 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.787 | 5.936 | 11.480 |
| NIW je Anteil | $ 10,05 | $ 10,64 | $ 10,77 |
| Class E CHF (Hedged): Thesaurierende Anteile | CHF 52.856 | CHF 143.082 | CHF 206.889 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.404 | 13.629 | 19.422 |
| NIW je Anteil | CHF 9,78 | CHF 10,50 | CHF 10,65 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € 55.943 | € 117.942 | € 339.870 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.986 | 9.883 | 28.142 |
| NIW je Anteil | € 11,22 | € 11,93 | € 12,08 |
| Class M Retail: Ausschüttende Anteile | $ 609 | $ 1.091 | $ 1.968 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 74 | 120 | 206 |
| NIW je Anteil | $ 8,26 | $ 9,11 | $ 9,54 |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € 9 | € 20 | € 20 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 2 | 2 |
| NIW je Anteil | € 9,34 | € 9,84 | € 9,87 |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | £ 48 | £ 142 | £ 198 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6 | 15 | 21 |
| NIW je Anteil | £ 8,30 | £ 9,16 | £ 9,57 |
| Class S: Thesaurierende Anteile | $ 41 | $ 886 | $ 1.636 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | 89 | 164 |
| NIW je Anteil | $ 9,49 | $ 9,96 | $ 9,99 |
| Class S EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € 172 | € 984 | € 2.358 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18 | 99 | 236 |
| NIW je Anteil | € 9,45 | € 9,96 | € 9,99 |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | $ 17.112 | $ 37.852 | $ 71.853 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.798 | 3.597 | 6.521 |
| NIW je Anteil | $ 9,52 | $ 10,52 | $ 11,02 |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 105.149 | $ 164.265 | $ 547.889 |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | $ 66.350 | $ 96.366 | $ 107.617 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.728 | 7.694 | 7.966 |
| NIW je Anteil | $ 11,58 | $ 12,52 | $ 13,51 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: Thesaurierende Anteile | € 10.373 | € 17.092 | € 92.632 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 869 | 1.475 | 8.436 |
| NIW je Anteil | € 11,94 | € 11,59 | € 10,98 |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ 8.051 | $ 13.599 | $ 48.399 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 740 | 1.146 | 3.747 |
| NIW je Anteil | $ 10,88 | $ 11,87 | $ 12,92 |
| Ausschüttende Anteile | $ 3.137 | $ 5.514 | $ 9.654 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 339 | 541 | 862 |
| NIW je Anteil | $ 9,25 | $ 10,19 | $ 11,19 |
| Class E EUR (Unhedged): Thesaurierende Anteile | € 14.823 | € 23.009 | € 184.547 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.229 | 1.948 | 16.349 |
| NIW je Anteil | € 12,06 | € 11,81 | € 11,29 |
| Class R: Thesaurierende Anteile | $ 232 | $ 251 | $ 271 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 28 | 28 | 28 |
| NIW je Anteil | $ 8,40 | $ 9,09 | $ 9,82 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)** | | | |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 9 | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 7,97 | $ 8,77 | $ 9,63 |
| **PIMCO Emerging Multi-Asset Fund** | | | |
| Nettovermögen | k. A. | $ 439.737 | $ 461.425 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 690 | $ 672 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 79 | 74 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 8,69 | $ 9,04 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 5.187 | € 4.828 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 490 | 482 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,59 | € 10,01 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | € 213 | € 206 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 22 | 22 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,83 | € 9,57 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 9.949 | € 15.874 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 973 | 1.624 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,23 | € 9,78 |
| Class G Retail EUR (Partially Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | € 130 | € 134 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 14 | 15 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,56 | € 9,23 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 420.317 | $ 431.758 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 53.355 | 51.099 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 7,88 | $ 8,45 |
| **PIMCO EqS Emerging Markets Fund** | | | |
| Nettovermögen | k. A. | $ 569.869 | $ 1.467.945 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 1.936 | $ 93.700 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 232 | 10.648 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 8,34 | $ 8,80 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 55.844 | € 307.907 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 5.700 | 33.955 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,80 | € 9,07 |
| Income II Shares | k. A. | € 96.510 | € 127.558 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 9.282 | 12.845 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,40 | € 9,93 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 293.879 | € 497.135 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 31.384 | 56.663 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,36 | € 8,77 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 9,86 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 27.969 | $ 89.205 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3.558 | 10.559 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 7,86 | $ 8,45 |
| **PIMCO EqS Pathfinder Fund™** | | | |
| Nettovermögen | k. A. | $ 197.176 | $ 902.229 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 6.333 | $ 8.085 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 460 | 590 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 13,76 | $ 13,70 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO EqS Pathfinder Fund™ (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | $ 80.345 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 6.248 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 12,86 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 40.809 | € 193.156 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2.908 | 14.457 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 14,03 | € 13,36 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 45.015 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 4.242 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,61 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 10 | $ 32 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 2 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 13,26 | $ 13,24 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 39.705 | $ 46.226 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3.054 | 3.529 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 13,00 | $ 13,10 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 1.584 | $ 1.306 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 125 | 102 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 12,64 | $ 12,86 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 48.185 | € 317.643 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3.808 | 26.052 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 12,65 | € 12,19 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | $ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 11,98 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 11,40 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 41.856 | $ 336 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3.359 | 27 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 12,46 | $ 12,69 |
| **PIMCO EqS Pathfinder Europe Fund™** | | | |
| Nettovermögen | k. A. | € 38.845 | € 41.545 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 1.428 | € 1.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 101 | 95 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 14,14 | € 13,38 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 35.070 | € 37.859 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2.600 | 2.931 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 13,49 | € 12,92 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | € 2.347 | € 2.399 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 183 | 193 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 12,79 | € 12,46 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 11,85 |
| **Euro Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 1.085.209 | € 1.061.647 | € 921.055 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 748.570 | € 578.177 | € 452.198 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.069 | 25.696 | 22.582 |
| NIW je Anteil | € 22,64 | € 22,50 | € 20,02 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Euro Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 26.291 | € 22.118 | € 9.341 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.708 | 1.421 | 662 |
| NIW je Anteil | € 15,40 | € 15,56 | € 14,11 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 32.366 | CHF 34.315 | CHF 14.974 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.014 | 1.071 | 524 |
| NIW je Anteil | CHF 31,92 | CHF 32,04 | CHF 28,59 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 35.501 | € 55.407 | € 66.482 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.644 | 2.572 | 3.456 |
| NIW je Anteil | € 21,59 | € 21,54 | € 19,24 |
| Ausschüttende Anteile | € 2.867 | € 4.639 | € 8.908 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 194 | 310 | 657 |
| NIW je Anteil | € 14,78 | € 14,94 | € 13,55 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 3.846 | € 4.262 | € 9.306 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 184 | 204 | 497 |
| NIW je Anteil | € 20,96 | € 20,94 | € 18,73 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 98.240 | € 130.989 | € 90.104 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.743 | 6.306 | 4.830 |
| NIW je Anteil | € 20,71 | € 20,77 | € 18,65 |
| Ausschüttende Anteile | € 49.745 | € 43.943 | € 30.228 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.431 | 3.871 | 2.936 |
| NIW je Anteil | € 11,23 | € 11,35 | € 10,30 |
| Class G Institutional: | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 285 | € 355 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26 | 32 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,85 | € 10,94 | k. A. |
| Class S: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 89.802 | € 193.199 | € 242.269 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.846 | 16.984 | 23.927 |
| NIW je Anteil | € 11,44 | € 11,38 | € 10,13 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 297 | € 18 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 2 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,13 | € 10,20 | k. A. |
| **Euro Credit Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 442.476 | € 739.390 | € 305.514 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 204.867 | € 213.960 | € 163.771 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.951 | 14.622 | 12.148 |
| NIW je Anteil | € 14,68 | € 14,63 | € 13,48 |
| Income II Shares | € 54.859 | € 126.306 | € 26.585 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.234 | 11.821 | 2.642 |
| NIW je Anteil | € 10,48 | € 10,69 | € 10,06 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 182.750 | € 399.124 | € 115.158 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.839 | 32.232 | 10.005 |
| NIW je Anteil | € 12,32 | € 12,38 | € 11,51 |
| **Euro Income Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 796.562 | € 952.521 | € 316.620 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 48.235 | € 126.826 | € 32.487 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.729 | 9.863 | 2.654 |
| NIW je Anteil | € 12,94 | € 12,86 | € 12,24 |
| Ausschüttende Anteile | € 90.406 | € 26.452 | € 7.564 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.519 | 2.408 | 696 |
| NIW je Anteil | € 10,61 | € 10,98 | € 10,87 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Euro Income Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Investor Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 17.727 | € 17.009 | € 13.082 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.670 | 1.543 | 1.194 |
| NIW je Anteil | € 10,61 | € 11,03 | € 10,96 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 137.853 | € 180.847 | € 52.828 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.133 | 14.561 | 4.429 |
| NIW je Anteil | € 12,38 | € 12,42 | € 11,93 |
| Ausschüttende Anteile | € 500.386 | € 601.348 | € 210.659 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 49.343 | 56.741 | 19.888 |
| NIW je Anteil | € 10,14 | € 10,60 | € 10,59 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.223 | € 32 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 125 | 3 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,80 | € 9,87 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 732 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 79 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,30 | € 9,77 | k. A. |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 527.034 | € 644.711 | € 366.137 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 527.034 | € 644.711 | € 366.137 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.773 | 29.781 | 22.260 |
| NIW je Anteil | € 21,27 | € 21,65 | € 16,45 |
| **Euro Low Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 66.960 | € 233.144 | € 654.889 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 41.868 | € 208.503 | € 233.350 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.730 | 18.459 | 21.372 |
| NIW je Anteil | € 11,23 | € 11,30 | € 10,92 |
| Institutional AUD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | AUD 9.958 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.000 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 9,96 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 18.423 | € 24.641 | € 421.539 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.818 | 2.395 | 42.006 |
| NIW je Anteil | € 10,13 | € 10,29 | € 10,04 |
| **Euro Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 28.266 | € 26.916 | € 23.809 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 28.266 | € 26.916 | € 23.809 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.110 | 2.054 | 1.920 |
| NIW je Anteil | € 13,40 | € 13,10 | € 12,40 |
| **Euro Short-Term Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 849.416 | € 575.302 | € 475.088 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 802.102 | € 399.184 | € 401.070 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 65.589 | 32.694 | 33.342 |
| NIW je Anteil | € 12,23 | € 12,21 | € 12,03 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 1.211 | € 3.155 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 102 | 269 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 11,85 | € 11,71 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 47.314 | € 174.907 | € 70.863 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.162 | 15.298 | 6.243 |
| NIW je Anteil | € 11,37 | € 11,43 | € 11,35 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Euro Ultra-Long Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 52.890 | € 122.229 | € 88.082 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 52.890 | € 122.229 | € 88.082 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.896 | 4.172 | 4.293 |
| NIW je Anteil | € 27,90 | € 29,30 | € 20,52 |
| **Global Advantage Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 709.571 | $ 646.274 | $ 722.577 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 20.766 | $ 28.500 | $ 55.638 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.744 | 2.245 | 4.335 |
| NIW je Anteil | $ 11,91 | $ 12,70 | $ 12,84 |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | CHF 114.131 | CHF 141.740 | CHF 133.501 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.205 | 13.110 | 12.897 |
| NIW je Anteil | CHF 10,19 | CHF 10,81 | CHF 10,35 |
| Institutional DKK (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | DKK 621.189 | DKK 625.934 | DKK 584.518 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 60.929 | 60.929 | 60.929 |
| NIW je Anteil | DKK 10,19 | DKK 10,27 | DKK 9,59 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 362.225 | € 216.281 | € 188.857 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.137 | 17.910 | 16.790 |
| NIW je Anteil | € 12,02 | € 12,08 | € 11,25 |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 11.325 | £ 11.479 | £ 10.777 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.088 | 1.088 | 1.080 |
| NIW je Anteil | £ 10,40 | £ 10,55 | £ 9,98 |
| Institutional NOK (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 411.678 | NOK 367.452 | NOK 272.736 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.412 | 3.106 | 2.556 |
| NIW je Anteil | NOK 120,64 | NOK 118,29 | NOK 106,71 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | $ 8.088 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 639 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 12,66 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 7.219 | $ 14.204 | $ 25.858 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 738 | 1.348 | 2.404 |
| NIW je Anteil | $ 9,78 | $ 10,53 | $ 10,76 |
| Ausschüttende Anteile | $ 324 | $ 492 | $ 531 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35 | 48 | 50 |
| NIW je Anteil | $ 9,36 | $ 10,22 | $ 10,54 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 18.448 | € 24.844 | € 36.825 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.620 | 2.150 | 3.388 |
| NIW je Anteil | € 11,38 | € 11,55 | € 10,87 |
| Class R GBP (Partially Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 10 | £ 10 | £ 360 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 37 |
| NIW je Anteil | £ 9,67 | £ 9,99 | £ 9,65 |
| Class T EUR (Partially Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 63 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,81 | € 10,00 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 8,85 | $ 9,59 | $ 9,83 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Global Advantage Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 473.864 | $ 657.860 | $ 535.454 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 21.830 | $ 65.394 | $ 65.446 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.622 | 6.860 | 6.817 |
| NIW je Anteil | $ 8,32 | $ 9,53 | $ 9,60 |
| Institutional CHF (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 10.001 | CHF 22.726 | CHF 25.182 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.066 | 2.174 | 2.604 |
| NIW je Anteil | CHF 9,38 | CHF 10,46 | CHF 9,67 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 98.047 | € 154.809 | € 136.185 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.519 | 14.099 | 13.531 |
| NIW je Anteil | € 10,30 | € 10,98 | € 10,07 |
| Ausschüttende Anteile | € 70.252 | € 75.770 | € 72.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.209 | 8.154 | 8.322 |
| NIW je Anteil | € 8,56 | € 9,29 | € 8,69 |
| Income II Shares | € 40.856 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.519 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,04 | k. A. | k. A. |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 19.952 | £ 40.358 | £ 79.787 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.249 | 4.121 | 8.510 |
| NIW je Anteil | £ 8,87 | £ 9,79 | £ 9,38 |
| Institutional USD (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 187.303 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 18.028 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,39 | k. A. |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | $ 17 | $ 2.214 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2 | 231 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,48 | $ 9,58 |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9.782 | € 10.366 | € 412 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.015 | 1.006 | 43 |
| NIW je Anteil | € 9,64 | € 10,31 | € 9,49 |
| Investor GBP (Partially Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 38 | £ 42 | £ 1.098 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | 4 | 117 |
| NIW je Anteil | £ 8,88 | £ 9,80 | £ 9,38 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 2.991 | $ 3.024 | $ 2.845 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 393 | 344 | 318 |
| NIW je Anteil | $ 7,61 | $ 8,79 | $ 8,93 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 146.351 | € 8.391 | € 10.528 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.410 | 875 | 1.187 |
| NIW je Anteil | € 8,92 | € 9,59 | € 8,87 |
| Class G Institutional EUR (Partially Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 24 | € 16 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,85 | € 10,70 | k. A. |
| Class R GBP (Partially Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 13 | £ 31 | £ 186 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 3 | 21 |
| NIW je Anteil | £ 8,48 | £ 9,36 | £ 8,96 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 12.730 | $ 14.480 | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.701 | 1.653 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 7,48 | $ 8,76 | $ 9,00 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 7.854.647 | $ 7.609.702 | $ 8.122.826 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 2.253.607 | $ 2.206.833 | $ 1.891.082 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 81.098 | 80.133 | 74.834 |
| NIW je Anteil | $ 27,79 | $ 27,54 | $ 25,27 |
| Ausschüttende Anteile | $ 68.057 | $ 47.746 | $ 129.096 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.906 | 2.695 | 7.734 |
| NIW je Anteil | $ 17,42 | $ 17,72 | $ 16,69 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 261.166 | CHF 289.568 | CHF 289.685 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.440 | 9.298 | 10.111 |
| NIW je Anteil | CHF 30,94 | CHF 31,14 | CHF 28,65 |
| Ausschüttende Anteile | CHF 189.627 | CHF 181.359 | CHF 175.670 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.257 | 8.573 | 8.790 |
| NIW je Anteil | CHF 20,49 | CHF 21,16 | CHF 19,98 |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 42.903 | € 61.667 | € 65.141 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.592 | 5.561 | 6.817 |
| NIW je Anteil | € 11,94 | € 11,09 | € 9,56 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 579.625 | € 477.997 | € 417.741 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.903 | 18.974 | 18.060 |
| NIW je Anteil | € 25,31 | € 25,19 | € 23,13 |
| Ausschüttende Anteile | € 222.357 | € 195.326 | € 144.887 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.259 | 10.544 | 8.294 |
| NIW je Anteil | € 18,14 | € 18,53 | € 17,47 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 308 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 31 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,00 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 153.479 | £ 32.840 | £ 139.171 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.928 | 1.716 | 7.958 |
| NIW je Anteil | £ 19,36 | £ 19,14 | £ 17,51 |
| Ausschüttende Anteile | £ 291.396 | £ 146.735 | £ 149.560 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.378 | 11.119 | 12.065 |
| NIW je Anteil | £ 13,02 | £ 13,20 | £ 12,40 |
| Institutional ILS (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | ILS 2.050 | ILS 2.222 | ILS 9.467 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 145 | 159 | 740 |
| NIW je Anteil | ILS 14,10 | ILS 14,00 | ILS 12,79 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 1.553.077 | NOK 1.403.847 | NOK 2.525.523 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.219 | 7.562 | 15.043 |
| NIW je Anteil | NOK 188,94 | NOK 185,64 | NOK 167,89 |
| Institutional NZD (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | NZD 508.258 | NZD 673.424 | NZD 668.002 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.747 | 17.130 | 18.617 |
| NIW je Anteil | NZD 39,87 | NZD 39,31 | NZD 35,88 |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK 932.081 | SEK 938.867 | SEK 865.223 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.784 | 4.836 | 4.879 |
| NIW je Anteil | SEK 194,82 | SEK 194,16 | SEK 177,35 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SGD 69.087 | SGD 135.098 | SGD 330.822 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.519 | 8.978 | 23.953 |
| NIW je Anteil | SGD 15,29 | SGD 15,05 | SGD 13,81 |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 428.737 | $ 413.396 | $ 604.116 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.645 | 14.586 | 21.717 |
| NIW je Anteil | $ 27,40 | $ 28,34 | $ 27,82 |
| Ausschüttende Anteile | $ 6.049 | $ 41.374 | $ 39.940 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 305 | 1.966 | 1.883 |
| NIW je Anteil | $ 19,84 | $ 21,05 | $ 21,21 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 260.462 | $ 301.024 | $ 279.161 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.935 | 11.544 | 11.627 |
| NIW je Anteil | $ 26,22 | $ 26,08 | $ 24,01 |
| Ausschüttende Anteile | $ 27.118 | $ 11.714 | $ 29.251 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.852 | 787 | 2.086 |
| NIW je Anteil | $ 14,64 | $ 14,89 | $ 14,02 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 260.351 | CHF 225.188 | CHF 173.320 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.341 | 18.277 | 15.237 |
| NIW je Anteil | CHF 12,20 | CHF 12,32 | CHF 11,38 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 111.318 | € 95.382 | € 99.545 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.572 | 3.922 | 4.443 |
| NIW je Anteil | € 24,35 | € 24,32 | € 22,41 |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 25.113 | £ 22.023 | £ 29.794 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.346 | 1.191 | 1.755 |
| NIW je Anteil | £ 18,65 | £ 18,50 | £ 16,98 |
| Investor NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 84.082 | NOK 89.287 | NOK 111.608 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 460 | 496 | 683 |
| NIW je Anteil | NOK 182,72 | NOK 180,15 | NOK 163,50 |
| Investor USD (Currency Exposure) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 7.734 | $ 11.808 | $ 21.984 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 293 | 431 | 815 |
| NIW je Anteil | $ 26,38 | $ 27,38 | $ 26,97 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 26.608 | $ 18.411 | $ 26.841 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.033 | 717 | 1.134 |
| NIW je Anteil | $ 25,77 | $ 25,67 | $ 23,67 |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 1.485 | £ 1.359 | £ 1.762 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 102 | 92 | 128 |
| NIW je Anteil | £ 14,51 | £ 14,71 | £ 13,81 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 212.427 | $ 180.515 | $ 172.067 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.360 | 7.103 | 7.313 |
| NIW je Anteil | $ 25,41 | $ 25,41 | $ 23,53 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 237.113 | $ 199.540 | $ 128.331 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.837 | 15.592 | 10.641 |
| NIW je Anteil | $ 12,59 | $ 12,80 | $ 12,06 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 286.172 | € 281.139 | € 330.276 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.359 | 12.088 | 15.321 |
| NIW je Anteil | € 23,15 | € 23,26 | € 21,55 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 5.218 | £ 5.415 | £ 7.299 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 396 | 405 | 582 |
| NIW je Anteil | £ 13,18 | £ 13,36 | £ 12,55 |
| Class E USD (Currency Exposure): | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 56.774 | $ 7.676 | $ 11.018 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.868 | 631 | 914 |
| NIW je Anteil | $ 11,66 | $ 12,17 | $ 12,05 |
| Ausschüttende Anteile | $ 5.171 | $ 4.916 | $ 4.816 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 487 | 437 | 424 |
| NIW je Anteil | $ 10,61 | $ 11,26 | $ 11,35 |
| Class G Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 92.847 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.478 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,80 | k. A. | k. A. |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 366.466 | € 338.201 | € 328.454 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.868 | 32.305 | 33.339 |
| NIW je Anteil | € 10,22 | € 10,47 | € 9,85 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 305.819 | $ 427.170 | $ 172.736 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.246 | 15.821 | 6.960 |
| NIW je Anteil | $ 27,19 | $ 27,00 | $ 24,82 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.644 | $ 1.128 | $ 809 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 151 | 104 | 81 |
| NIW je Anteil | $ 10,88 | $ 10,81 | $ 9,95 |
| Class R USD (Currency Exposure): | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 165 | $ 137 | $ 200 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17 | 14 | 21 |
| NIW je Anteil | $ 9,46 | $ 9,81 | $ 9,66 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 785 | € 397 | € 1.800 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 73 | 37 | 181 |
| NIW je Anteil | € 10,80 | € 10,78 | € 9,92 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 3.246 | £ 3.455 | £ 2.973 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 317 | 333 | 305 |
| NIW je Anteil | £ 10,24 | £ 10,38 | £ 9,75 |
| Class S: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 865 | $ 2.361 | $ 18.724 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 78 | 216 | 1.866 |
| NIW je Anteil | $ 11,03 | $ 10,93 | $ 10,03 |
| Class S GBP (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 269 | £ 227 | £ 18.122 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 24 | 21 | 1.801 |
| NIW je Anteil | £ 11,13 | £ 11,00 | £ 10,06 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 2.007 | $ 50 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 198 | 5 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,14 | $ 10,17 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 555 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 55 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,03 | $ 10,16 | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.313 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 129 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,14 | € 10,22 | k. A. |
| Class Z USD (Currency Exposure): | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 16 | $ 16 | $ 16 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 2 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,21 | $ 10,75 | $ 10,76 |
| | Global Bond Ex-US Fund | | |
| Nettovermögen | $ 708.912 | $ 698.384 | $ 649.619 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 523.409 | $ 490.802 | $ 472.275 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26.860 | 25.371 | 27.150 |
| NIW je Anteil | $ 19,49 | $ 19,35 | $ 17,40 |
| Ausschüttende Anteile | $ 54.851 | $ 56.934 | $ 51.394 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.747 | 3.854 | 3.786 |
| NIW je Anteil | $ 14,64 | $ 14,77 | $ 13,57 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 23.937 | € 17.491 | € 7.048 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.507 | 1.105 | 491 |
| NIW je Anteil | € 15,88 | € 15,83 | € 14,24 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 14.789 | $ 11.048 | $ 17.207 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 786 | 589 | 1.017 |
| NIW je Anteil | $ 18,82 | $ 18,75 | $ 16,92 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10.828 | $ 18.703 | $ 12.669 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 588 | 1.018 | 763 |
| NIW je Anteil | $ 18,42 | $ 18,38 | $ 16,61 |
| Class E: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 77.743 | $ 99.656 | $ 86.438 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.468 | 6.946 | 6.556 |
| NIW je Anteil | $ 14,22 | $ 14,35 | $ 13,18 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.290 | $ 75 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 115 | 7 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 11,25 | $ 11,19 | $ 10,10 |
| | PIMCO Global Dividend Fund | | |
| Nettovermögen | $ 69.141 | $ 85.465 | $ 1.412.539 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 706 | $ 250 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 74 | 24 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,51 | $ 10,45 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 4.120 | $ 13.966 | $ 188.280 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 365 | 1.075 | 14.522 |
| NIW je Anteil | $ 11,28 | $ 12,99 | $ 12,97 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 12.710 | € 19.961 | € 121.401 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.010 | 1.489 | 9.977 |
| NIW je Anteil | € 12,58 | € 13,41 | € 12,17 |
| Ausschüttende Anteile | € 228 | € 113 | € 85.574 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19 | 8 | 6.628 |
| NIW je Anteil | € 12,31 | € 13,76 | € 12,91 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 107.483 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 10.088 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,65 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 161 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 14 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 11,49 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Global Dividend Fund (Forts.)** | | | |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,44 | $ 10,41 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 9 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 8,72 | $ 10,08 | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 3.946 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 426 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,25 | $ 10,31 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 10.476 | $ 10.212 | $ 8.936 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.045 | 872 | 754 |
| NIW je Anteil | $ 10,03 | $ 11,71 | $ 11,85 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 6.945 | € 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 686 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,13 | € 10,94 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 25.599 | € 30.205 | € 406.052 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.163 | 2.253 | 31.839 |
| NIW je Anteil | € 11,83 | € 13,41 | € 12,75 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 108 | € 98 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11 | 9 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,04 | € 11,05 | k. A. |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | £ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 11,45 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 279 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,62 | € 10,43 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 31 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,13 | € 10,38 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 13 | $ 15 | $ 222.244 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 17.048 |
| NIW je Anteil | $ 11,53 | $ 13,18 | $ 13,04 |
| **Global High Yield Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 3.852.422 | $ 3.897.419 | $ 6.111.190 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 656.931 | $ 407.732 | $ 808.419 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.460 | 20.650 | 42.172 |
| NIW je Anteil | $ 19,63 | $ 19,75 | $ 19,17 |
| Ausschüttende Anteile | $ 158.200 | $ 231.667 | $ 306.087 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.334 | 21.139 | 27.195 |
| NIW je Anteil | $ 10,32 | $ 10,96 | $ 11,26 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 33.861 | CHF 22.236 | CHF 48.953 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.375 | 1.531 | 3.461 |
| NIW je Anteil | CHF 14,26 | CHF 14,52 | CHF 14,14 |
| Ausschüttende Anteile | CHF 19.733 | CHF 16.149 | CHF 16.149 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.122 | 1.614 | 1.565 |
| NIW je Anteil | CHF 9,30 | CHF 10,01 | CHF 10,32 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 528.859 | € 671.673 | € 968.245 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.243 | 34.262 | 50.831 |
| NIW je Anteil | € 19,41 | € 19,60 | € 19,05 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Global High Yield Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 99.954 | € 89.202 | € 123.028 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.372 | 7.003 | 9.388 |
| NIW je Anteil | € 11,94 | € 12,74 | € 13,11 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 28.784 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.834 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,16 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 78.388 | £ 69.990 | £ 99.589 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.456 | 5.735 | 8.427 |
| NIW je Anteil | £ 12,14 | £ 12,20 | £ 11,82 |
| Ausschüttende Anteile | £ 706.652 | £ 630.629 | £ 835.162 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 124.140 | 104.287 | 134.755 |
| NIW je Anteil | £ 5,69 | £ 6,05 | £ 6,20 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 2.403 | NOK 29.384 | NOK 179.103 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18 | 220 | 1.401 |
| NIW je Anteil | NOK 133,63 | NOK 133,34 | NOK 127,82 |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | SEK 323.202 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3.249 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | SEK 99,47 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 5.951 | € 11.033 | € 16.147 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 312 | 571 | 857 |
| NIW je Anteil | € 19,08 | € 19,32 | € 18,85 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 183.401 | $ 128.254 | $ 252.851 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.689 | 6.703 | 13.545 |
| NIW je Anteil | $ 18,93 | $ 19,13 | $ 18,67 |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | $ 322 | $ 5.575 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 33 | 557 |
| NIW je Anteil | $ 10,05 | $ 9,75 | $ 10,01 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 3.399 | € 13.455 | € 28.301 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 343 | 1.272 | 2.600 |
| NIW je Anteil | € 9,91 | € 10,58 | € 10,88 |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 2.705 | £ 6.219 | £ 10.369 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 265 | 573 | 933 |
| NIW je Anteil | £ 10,21 | £ 10,85 | £ 11,12 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 169.949 | $ 182.975 | $ 261.893 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.409 | 9.982 | 14.584 |
| NIW je Anteil | $ 18,06 | $ 18,33 | $ 17,96 |
| Ausschüttende Anteile | $ 184.955 | $ 250.334 | $ 330.668 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.209 | 23.215 | 29.860 |
| NIW je Anteil | $ 10,16 | $ 10,78 | $ 11,07 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 142.509 | € 200.082 | € 382.874 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.104 | 9.792 | 19.110 |
| NIW je Anteil | € 20,06 | € 20,43 | € 20,04 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 1.855 | £ 3.846 | £ 7.201 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 155 | 302 | 552 |
| NIW je Anteil | £ 11,98 | £ 12,72 | £ 13,04 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 431 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,70 | k. A. | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | | |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 11.392 | € 16.838 | € 13.737 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.136 | 1.562 | 1.242 |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 10,78 | € 11,06 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 319.300 | $ 194.572 | $ 180.201 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.731 | 10.120 | 9.638 |
| NIW je Anteil | $ 19,08 | $ 19,23 | $ 18,70 |
| Ausschüttende Anteile | $ 6.761 | $ 10.849 | $ 6.007 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 739 | 1.116 | 602 |
| NIW je Anteil | $ 9,15 | $ 9,72 | $ 9,98 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 10,01 |
| Class M Retail: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 45.682 | $ 44.456 | $ 119.059 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.560 | 4.183 | 10.909 |
| NIW je Anteil | $ 10,02 | $ 10,63 | $ 10,91 |
| Income II Shares | $ 38.648 | $ 33.887 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.315 | 3.515 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 8,96 | $ 9,64 | $ 10,01 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 2.425 | $ 2.122 | $ 1.892 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 221 | 192 | 176 |
| NIW je Anteil | $ 10,98 | $ 11,07 | $ 10,77 |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.110 | $ 1.573 | $ 1.790 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 119 | 158 | 175 |
| NIW je Anteil | $ 9,36 | $ 9,95 | $ 10,22 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 175 | € 123 | € 279 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16 | 11 | 26 |
| NIW je Anteil | € 10,89 | € 11,02 | € 10,74 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 2.399 | £ 1.872 | £ 2.897 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 255 | 187 | 283 |
| NIW je Anteil | £ 9,41 | £ 9,99 | £ 10,24 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.774 | $ 815 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 179 | 81 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,89 | $ 10,07 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.056 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 112 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,46 | $ 10,03 | k. A. |
| | Global Investment Grade Credit Fund | | |
| Nettovermögen | $ 12.796.716 | $ 12.332.618 | $ 17.428.685 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 2.548.866 | $ 2.210.197 | $ 2.111.034 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 154.359 | 134.521 | 138.049 |
| NIW je Anteil | $ 16,51 | $ 16,43 | $ 15,29 |
| Ausschüttende Anteile | $ 463.975 | $ 564.131 | $ 634.843 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.810 | 45.675 | 53.426 |
| NIW je Anteil | $ 11,96 | $ 12,35 | $ 11,88 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 470.701 | CHF 539.654 | CHF 581.908 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.304 | 34.423 | 39.757 |
| NIW je Anteil | CHF 15,53 | CHF 15,68 | CHF 14,64 |
| Ausschüttende Anteile | CHF 67.691 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.170 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,44 | k. A. | k. A. |
| Institutional CZK (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | CZK 592.417 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 61.562 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | CZK 9,62 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Currency Exposure) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 14.262 | € 6.978 | € 3.342 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.219 | 645 | 362 |
| NIW je Anteil | € 11,70 | € 10,82 | € 9,23 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 2.245.225 | € 1.589.443 | € 2.554.621 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 130.820 | 92.696 | 159.878 |
| NIW je Anteil | € 17,16 | € 17,15 | € 15,98 |
| Ausschüttende Anteile | € 530.056 | € 435.458 | € 1.139.194 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 43.820 | 34.689 | 94.172 |
| NIW je Anteil | € 12,10 | € 12,55 | € 12,10 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 117.263 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 11.726 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,00 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 480.855 | £ 463.924 | £ 664.473 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26.908 | 26.154 | 40.363 |
| NIW je Anteil | £ 17,87 | £ 17,74 | £ 16,46 |
| Ausschüttende Anteile | £ 1.421.651 | £ 1.226.584 | £ 1.182.554 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 106.928 | 89.508 | 89.897 |
| NIW je Anteil | £ 13,30 | £ 13,70 | £ 13,15 |
| Institutional HUF (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | HUF 3.024.069 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 319.040 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | HUF 9,48 | k. A. | k. A. |
| Institutional ILS (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | ILS 209.671 | ILS 214.171 | ILS 257.271 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.192 | 15.555 | 20.094 |
| NIW je Anteil | ILS 13,80 | ILS 13,77 | ILS 12,80 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 1.497.849 | NOK 1.342.424 | NOK 1.743.732 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.914 | 10.825 | 15.312 |
| NIW je Anteil | NOK 125,73 | NOK 124,02 | NOK 113,88 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional NZD (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | NZD | 65 | NZD | 251 | NZD | 29.104 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6 | | 21 | | 2.665 |
| NIW je Anteil | NZD | 11,71 | NZD | 11,71 | NZD | 10,92 |
| Institutional PLN (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | PLN | 57.471 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.815 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | PLN | 9,88 | | k. A. | | k. A. |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK | 79.242 | SEK | 71.449 | SEK | 650.993 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.452 | | 4.914 | | 48.283 |
| NIW je Anteil | SEK | 14,53 | SEK | 14,54 | SEK | 13,48 |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SGD | 1.896 | SGD | 1.890 | SGD | 3.360 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 149 | | 151 | | 288 |
| NIW je Anteil | SGD | 12,70 | SGD | 12,54 | SGD | 11,69 |
| Ausschüttende Anteile | SGD | 15 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD | 9,90 | | k. A. | | k. A. |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 34.039 | $ | 24.951 | $ | 16.499 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.678 | | 1.906 | | 1.297 |
| NIW je Anteil | $ | 12,71 | $ | 13,09 | $ | 12,72 |
| Investor Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 249.388 | $ | 261.681 | $ | 383.683 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.527 | | 14.215 | | 22.316 |
| NIW je Anteil | $ | 18,44 | $ | 18,41 | $ | 17,20 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 76.711 | $ | 94.100 | $ | 124.526 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.032 | | 7.163 | | 9.852 |
| NIW je Anteil | $ | 12,72 | $ | 13,14 | $ | 12,64 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 8.644 | CHF | 10.937 | CHF | 15.710 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 741 | | 926 | | 1.420 |
| NIW je Anteil | CHF | 11,66 | CHF | 11,81 | CHF | 11,06 |
| Ausschüttende Anteile | CHF | 15.641 | CHF | 25.098 | CHF | 31.898 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.287 | | 1.969 | | 2.592 |
| NIW je Anteil | CHF | 12,16 | CHF | 12,74 | CHF | 12,30 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 55.357 | € | 88.504 | € | 153.999 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.337 | | 5.322 | | 9.902 |
| NIW je Anteil | € | 16,59 | € | 16,63 | € | 15,55 |
| Ausschüttende Anteile | € | 115.709 | € | 166.692 | € | 182.971 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.124 | | 12.667 | | 14.428 |
| NIW je Anteil | € | 12,68 | € | 13,16 | € | 12,68 |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 10.689 | £ | 19.009 | £ | 26.289 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 829 | | 1.430 | | 2.061 |
| NIW je Anteil | £ | 12,90 | £ | 13,29 | £ | 12,76 |
| Investor SGD (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | | k. A. | SGD | 541 | SGD | 1.923 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 54 | | 199 |
| NIW je Anteil | | k. A. | SGD | 10,04 | SGD | 9,67 |
| Administrative Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 86.762 | $ | 116.227 | $ | 197.678 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 5.438 | | 7.284 | | 13.245 |
| NIW je Anteil | $ | 15,96 | $ | 15,96 | $ | 14,93 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 37.046 | $ | 42.097 | $ | 81.495 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.013 | | 3.315 | | 6.670 |
| NIW je Anteil | $ | 12,29 | $ | 12,70 | $ | 12,22 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | | | | |
| Administrative CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 2.718 | CHF | 2.485 | CHF | 239 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 262 | | 236 | | 24 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,37 | CHF | 10,52 | CHF | 9,87 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 10.464 | € | 21.328 | € | 23.928 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 661 | | 1.342 | | 1.609 |
| NIW je Anteil | € | 15,82 | € | 15,89 | € | 14,88 |
| Ausschüttende Anteile | € | 1.607 | € | 1.725 | € | 4.380 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 131 | | 136 | | 362 |
| NIW je Anteil | € | 12,24 | € | 12,70 | € | 12,24 |
| Administrative GBP (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 7.605 | £ | 6.345 | £ | 7.656 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 593 | | 480 | | 603 |
| NIW je Anteil | £ | 12,83 | £ | 13,22 | £ | 12,69 |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK | 221.365 | SEK | 157.163 | SEK | 1.598 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 20.800 | | 14.688 | | 160 |
| NIW je Anteil | SEK | 10,64 | SEK | 10,70 | SEK | 9,97 |
| Class E: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 512.307 | $ | 516.244 | $ | 654.456 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 33.035 | | 33.156 | | 44.758 |
| NIW je Anteil | $ | 15,51 | $ | 15,57 | $ | 14,62 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 298.612 | $ | 276.095 | $ | 440.306 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 23.016 | | 20.601 | | 34.146 |
| NIW je Anteil | $ | 12,97 | $ | 13,40 | $ | 12,90 |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 27.784 | CHF | 41.573 | CHF | 53.244 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.523 | | 3.707 | | 5.039 |
| NIW je Anteil | CHF | 11,01 | CHF | 11,22 | CHF | 10,57 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 401.682 | € | 491.752 | € | 956.548 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 25.562 | | 31.042 | | 64.228 |
| NIW je Anteil | € | 15,71 | € | 15,84 | € | 14,89 |
| Ausschüttende Anteile | € | 219.741 | € | 269.308 | € | 359.682 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 21.062 | | 24.879 | | 34.483 |
| NIW je Anteil | € | 10,43 | € | 10,82 | € | 10,43 |
| Class E GBP (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 33.969 | £ | 75.257 | £ | 116.986 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.536 | | 5.453 | | 8.830 |
| NIW je Anteil | £ | 13,39 | £ | 13,80 | £ | 13,24 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD | 12.729 | SGD | 8.866 | SGD | 15.129 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.277 | | 867 | | 1.535 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,97 | SGD | 10,23 | SGD | 9,85 |
| Class G Institutional: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 29.524 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.032 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,74 | | k. A. | | k. A. |
| Class G Retail EUR (Currency Exposure): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 4.992 | € | 4.236 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 436 | | 392 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 11,45 | € | 10,81 | | k. A. |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 340 | € | 493 | € | 587 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32 | | 45 | | 56 |
| NIW je Anteil | € | 10,54 | € | 10,92 | € | 10,51 |
| Class H Institutional: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 78.398 | $ | 126.363 | $ | 58.318 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.509 | | 7.292 | | 3.610 |
| NIW je Anteil | $ | 17,39 | $ | 17,33 | $ | 16,16 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Class M Retail: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 9.374 | $ 9.953 | $ 7.862 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 955 | 981 | 806 |
| NIW je Anteil | $ 9,82 | $ 10,14 | $ 9,76 |
| Income II Shares | $ 72.932 | $ 4.044 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.453 | 395 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,79 | $ 10,24 | $ 9,99 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 17.148 | $ 8.825 | $ 11.111 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.605 | 828 | 1.117 |
| NIW je Anteil | $ 10,68 | $ 10,66 | $ 9,95 |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.949 | $ 3.038 | $ 4.107 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 303 | 302 | 425 |
| NIW je Anteil | $ 9,73 | $ 10,05 | $ 9,67 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 911 | € 891 | € 394 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 86 | 84 | 40 |
| NIW je Anteil | € 10,60 | € 10,62 | € 9,92 |
| Ausschüttende Anteile | € 639 | € 419 | € 39 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 66 | 41 | 4 |
| NIW je Anteil | € 9,74 | € 10,11 | € 9,71 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 18.498 | £ 13.319 | £ 7.222 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.892 | 1.322 | 747 |
| NIW je Anteil | £ 9,78 | £ 10,08 | £ 9,67 |
| Class S: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 110.520 | $ 187.983 | $ 77.165 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.242 | 17.509 | 7.721 |
| NIW je Anteil | $ 10,79 | $ 10,74 | $ 10,00 |
| Ausschüttende Anteile | $ 24.142 | $ 24.491 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.458 | 2.414 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,82 | $ 10,15 | k. A. |
| Class S CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 94.910 | CHF 66.080 | CHF 37.575 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.953 | 6.176 | 3.762 |
| NIW je Anteil | CHF 10,60 | CHF 10,70 | CHF 9,99 |
| Class S EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 254.801 | € 273.375 | € 241.040 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.720 | 25.474 | 24.107 |
| NIW je Anteil | € 10,74 | € 10,73 | € 10,00 |
| Ausschüttende Anteile | € 156 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,79 | € 10,04 | k. A. |
| Class S GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 27.586 | £ 20.504 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.837 | 2.045 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,72 | £ 10,02 | k. A. |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 656 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 66 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,97 | $ 10,05 | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 270 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,98 | € 10,10 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 17 | $ 17 | $ 86.648 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 1 | 7.725 |
| NIW je Anteil | $ 11,50 | $ 11,76 | $ 11,22 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | Global Low Duration Real Return Fund | | |
| Nettovermögen | $ 554.933 | $ 555.987 | |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 54.072 | $ 88.348 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.505 | 8.912 | |
| NIW je Anteil | $ 9,82 | $ 9,91 | |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.610 | $ 2.192 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 268 | 223 | |
| NIW je Anteil | $ 9,75 | $ 9,84 | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 9.579 | CHF 9.430 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 991 | 954 | |
| NIW je Anteil | CHF 9,66 | CHF 9,89 | |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 175.463 | € 79.306 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.982 | 8.013 | |
| NIW je Anteil | € 9,76 | € 9,90 | |
| Ausschüttende Anteile | € 2.332 | € 852 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 241 | 87 | |
| NIW je Anteil | € 9,69 | € 9,83 | |
| Income II Shares | € 44.884 | € 58.845 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.602 | 5.941 | |
| NIW je Anteil | € 9,75 | € 9,90 | |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 2.942 | £ 2.751 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 299 | 277 | |
| NIW je Anteil | £ 9,85 | £ 9,93 | |
| Ausschüttende Anteile | £ 22.069 | £ 21.037 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.254 | 2.132 | |
| NIW je Anteil | £ 9,79 | £ 9,87 | |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 35.234 | $ 3.637 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.646 | 370 | |
| NIW je Anteil | $ 9,66 | $ 9,84 | |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 9 | CHF 9 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | CHF 9,50 | CHF 9,81 | |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 160.796 | € 204.131 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.757 | 20.784 | |
| NIW je Anteil | € 9,60 | € 9,82 | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 6 | £ 6 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | |
| NIW je Anteil | £ 9,75 | £ 9,86 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | Global Multi-Asset Fund | | |
| Nettovermögen | $ 1.378.618 | $ 1.313.246 | $ 3.084.359 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 644.759 | $ 627.491 | $ 862.857 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.926 | 43.321 | 64.124 |
| NIW je Anteil | $ 14,35 | $ 14,48 | $ 13,46 |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | $ 76 | $ 484 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 6 | 40 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 12,79 | $ 12,25 |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | CAD 1.012 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 100 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | CAD 10,12 |

# Erläuterungen zum Abschluss (Forts.)

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Global Multi-Asset Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | CHF 2.880 | CHF 2.748 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 277 | 289 |
| NIW je Anteil | k. A. | CHF 10,38 | CHF 9,52 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 324.507 | € 174.610 | € 412.066 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.443 | 12.201 | 31.448 |
| NIW je Anteil | € 14,46 | € 14,31 | € 13,10 |
| Ausschüttende Anteile | € 1.271 | € 1.390 | € 3.039 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 128 | 136 | 314 |
| NIW je Anteil | € 9,94 | € 10,24 | € 9,67 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 4.134 | £ 2.808 | £ 5.511 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 398 | 274 | 588 |
| NIW je Anteil | £ 10,37 | £ 10,26 | £ 9,37 |
| Ausschüttende Anteile | £ 6.046 | £ 7.187 | £ 141.425 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 600 | 696 | 14.539 |
| NIW je Anteil | £ 10,07 | £ 10,33 | £ 9,73 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 7.170 | $ 8.074 | $ 14.831 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 658 | 732 | 1.443 |
| NIW je Anteil | $ 10,90 | $ 11,03 | $ 10,28 |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.485 | $ 679 | $ 3.547 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 159 | 69 | 375 |
| NIW je Anteil | $ 9,35 | $ 9,85 | $ 9,46 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.033 | € 357 | € 1.789 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 73 | 25 | 139 |
| NIW je Anteil | € 14,13 | € 14,03 | € 12,89 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 73.263 | $ 79.424 | $ 148.050 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.515 | 5.858 | 11.615 |
| NIW je Anteil | $ 13,29 | $ 13,56 | $ 12,75 |
| Ausschüttende Anteile | $ 7.681 | $ 4.988 | $ 6.829 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 838 | 520 | 735 |
| NIW je Anteil | $ 9,16 | $ 9,59 | $ 9,29 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | CHF 812 | CHF 821 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 77 | 83 |
| NIW je Anteil | k. A. | CHF 10,61 | CHF 9,85 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 214.094 | € 249.947 | € 394.956 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.006 | 18.654 | 31.813 |
| NIW je Anteil | € 13,38 | € 13,40 | € 12,41 |
| Ausschüttende Anteile | € 18.299 | € 24.655 | € 40.538 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.960 | 2.570 | 4.427 |
| NIW je Anteil | € 9,34 | € 9,59 | € 9,16 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 1.322 | £ 1.775 | £ 2.005 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 125 | 165 | 195 |
| NIW je Anteil | £ 10,55 | £ 10,77 | £ 10,26 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 29 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,11 | k. A. | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Global Multi-Asset Fund (Forts.)** | | | |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 17.277 | € 17.688 | € 19.592 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.789 | 1.756 | 2.096 |
| NIW je Anteil | € 9,66 | € 10,08 | € 9,35 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 529 | $ 989 | $ 2.174 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53 | 98 | 231 |
| NIW je Anteil | $ 10,00 | $ 10,11 | $ 9,41 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 143 | € 332 | € 378 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14 | 33 | 40 |
| NIW je Anteil | € 10,30 | € 10,22 | € 9,38 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 245 | £ 1.264 | £ 2.355 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25 | 128 | 252 |
| NIW je Anteil | £ 9,65 | £ 9,89 | £ 9,33 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | k. A. | $ 588.060 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 56.675 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 10,38 |
| **Global Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.509.343 | $ 2.361.832 | $ 3.561.225 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 399.031 | $ 418.343 | $ 361.455 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.482 | 23.121 | 21.803 |
| NIW je Anteil | $ 17,75 | $ 18,09 | $ 16,58 |
| Ausschüttende Anteile | $ 41.080 | $ 29.661 | $ 42.235 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.760 | 1.930 | 2.965 |
| NIW je Anteil | $ 14,88 | $ 15,37 | $ 14,24 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 142.751 | CHF 143.222 | CHF 186.239 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.126 | 10.758 | 15.216 |
| NIW je Anteil | CHF 12,83 | CHF 13,31 | CHF 12,24 |
| Ausschüttende Anteile | CHF 10 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,84 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 256.266 | € 206.983 | € 516.437 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.981 | 11.798 | 32.073 |
| NIW je Anteil | € 17,11 | € 17,54 | € 16,10 |
| Ausschüttende Anteile | € 56.149 | € 59.885 | € 76.934 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.979 | 4.086 | 5.653 |
| NIW je Anteil | € 14,11 | € 14,66 | € 13,61 |
| Income II Shares | € 81.143 | € 588 | € 3.392 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.086 | 56 | 347 |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 10,47 | € 9,77 |
| Institutional GBP (Currency Exposure) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | k. A. | £ 1.705 | £ 13.936 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 183 | 1.638 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 9,30 | £ 8,51 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 88.208 | £ 95.105 | £ 98.892 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.473 | 8.979 | 10.224 |
| NIW je Anteil | £ 10,41 | £ 10,59 | £ 9,67 |
| Ausschüttende Anteile | £ 33.919 | £ 45.412 | £ 95.383 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.051 | 5.263 | 11.966 |
| NIW je Anteil | £ 8,37 | £ 8,63 | £ 7,97 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Real Return Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SGD | 296.553 | SGD | 125.876 | SGD | 113.908 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 22.398 | | 9.387 | | 9.262 |
| NIW je Anteil | SGD | 13,24 | SGD | 13,41 | SGD | 12,30 |
| Institutional USD (Currency Exposure) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | | k. A. | $ | 76 | $ | 13.779 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 8 | | 1.480 |
| NIW je Anteil | | k. A. | $ | 9,58 | $ | 9,31 |
| Investor Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 77.648 | $ | 95.006 | $ | 143.136 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.568 | | 5.464 | | 8.953 |
| NIW je Anteil | $ | 17,00 | $ | 17,39 | $ | 15,99 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 16.553 | $ | 10.183 | $ | 8.432 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.271 | | 757 | | 676 |
| NIW je Anteil | $ | 13,02 | $ | 13,46 | $ | 12,47 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | CHF | 5.710 | CHF | 8.564 | CHF | 14.345 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 460 | | 655 | | 1.180 |
| NIW je Anteil | CHF | 12,42 | CHF | 13,07 | CHF | 12,15 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 14.808 | € | 35.813 | € | 59.881 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 902 | | 2.119 | | 3.848 |
| NIW je Anteil | € | 16,42 | € | 16,90 | € | 15,57 |
| Ausschüttende Anteile | € | 4.926 | € | 5.641 | € | 4.897 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 381 | | 420 | | 393 |
| NIW je Anteil | € | 12,93 | € | 13,44 | € | 12,48 |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ | 770 | £ | 802 | £ | 828 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 76 | | 78 | | 88 |
| NIW je Anteil | £ | 10,09 | £ | 10,30 | £ | 9,44 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 421 | £ | 881 | £ | 1.147 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 32 | | 65 | | 91 |
| NIW je Anteil | £ | 13,19 | £ | 13,60 | £ | 12,57 |
| Administrative Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 118.532 | $ | 153.925 | $ | 184.284 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.056 | | 8.944 | | 11.629 |
| NIW je Anteil | $ | 16,80 | $ | 17,21 | $ | 15,85 |
| Class E: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 177.899 | $ | 255.790 | $ | 308.978 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.970 | | 15.335 | | 20.037 |
| NIW je Anteil | $ | 16,22 | $ | 16,68 | $ | 15,42 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 30.775 | $ | 40.143 | $ | 58.384 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.437 | | 3.073 | | 4.812 |
| NIW je Anteil | $ | 12,63 | $ | 13,06 | $ | 12,13 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 453.438 | € | 254.501 | € | 579.416 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 28.983 | | 15.723 | | 38.640 |
| NIW je Anteil | € | 15,64 | € | 16,19 | € | 14,99 |
| Class E GBP (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 5.032 | £ | 5.281 | £ | 23.039 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 404 | | 411 | | 1.937 |
| NIW je Anteil | £ | 12,45 | £ | 12,85 | £ | 11,90 |
| Class H Institutional: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 14.966 | $ | 12.257 | $ | 11.364 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 860 | | 690 | | 697 |
| NIW je Anteil | $ | 17,40 | $ | 17,77 | $ | 16,31 |
| Class R: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 5.509 | $ | 6.683 | $ | 8.217 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 554 | | 658 | | 881 |
| NIW je Anteil | $ | 9,94 | $ | 10,16 | $ | 9,33 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Global Real Return Fund (Forts.) | | | | | |
| Class R EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 2.791 | € | 3.541 | € | 3.573 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 284 | | 351 | | 3.841 |
| NIW je Anteil | € | 9,82 | € | 10,10 | € | 9,29 |
| Class R GBP (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ | 4.165 | £ | 75 | £ | 110 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 417 | | 7 | | 121 |
| NIW je Anteil | £ | 9,99 | £ | 10,19 | £ | 9,33 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 591 | £ | 758 | £ | 2.359 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 61 | | 76 | | 2.551 |
| NIW je Anteil | £ | 9,73 | £ | 10,03 | £ | 9,27 |
| Class S: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 13.980 | $ | 13.396 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.404 | | 1.303 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,96 | $ | 10,28 | | k. A. |
| Class S CHF (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | CHF | 13.938 | CHF | 19.057 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.429 | | 1.858 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF | 9,75 | CHF | 10,25 | | k. A. |
| Class S EUR (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 33.061 | € | 42.796 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.345 | | 4.168 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,88 | € | 10,27 | | k. A. |
| Class S GBP (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 39.460 | £ | 48.911 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.946 | | 4.747 | | k. A. |
| NIW je Anteil | £ | 10,00 | £ | 10,30 | | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 202 | € | 8 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 21 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,75 | € | 10,12 | | k. A. |
| Class Z: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 15 | $ | 15 | $ | 14 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 11,41 | $ | 11,77 | $ | 10,90 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD | 9.664 | AUD | 13.942 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 917 | | 1.308 | | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD | 10,54 | AUD | 10,66 | | k. A. |
| | Income Fund | | | | | |
| Nettovermögen | $ | 12.520.941 | $ | 8.720.005 | $ | 4.257.893 |
| Institutional Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 1.390.724 | $ | 1.183.097 | $ | 406.071 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 113.180 | | 99.090 | | 36.473 |
| NIW je Anteil | $ | 12,29 | $ | 11,94 | $ | 11,13 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 1.155.629 | $ | 1.054.855 | $ | 467.495 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 106.420 | | 96.058 | | 43.864 |
| NIW je Anteil | $ | 10,86 | $ | 10,98 | $ | 10,66 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 13.697 | CHF | 513 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.342 | | 51 | | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF | 10,20 | CHF | 10,05 | | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | CHF | 16.326 | | k. A. | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.662 | | k. A. | | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF | 9,82 | | k. A. | | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 1.116.429 | € | 682.946 | € | 190.464 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 91.419 | | 57.361 | | 17.154 |
| NIW je Anteil | € | 12,21 | € | 11,91 | € | 11,10 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 254.174 | € 108.993 | € 256.785 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.602 | 9.973 | 24.217 |
| NIW je Anteil | € 10,77 | € 10,93 | € 10,61 |
| Income II Shares | € 211.620 | € 164.407 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.772 | 16.656 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,72 | € 9,87 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 32.296 | £ 71.637 | £ 69.853 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.180 | 6.992 | 7.045 |
| NIW je Anteil | £ 10,15 | £ 10,25 | £ 9,92 |
| Institutional HKD (Unhedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | HKD 79 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | HKD 9,85 | k. A. | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | SGD 41.594 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4.108 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | SGD 10,12 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | SGD 10 | SGD 12.816 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1.287 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 9,98 | SGD 9,96 | k. A. |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 18.404 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.798 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,23 | k. A. | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 291.061 | $ 151.611 | $ 36.654 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29.490 | 15.133 | 3.756 |
| NIW je Anteil | $ 9,87 | $ 10,02 | $ 9,76 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.335 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 134 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,93 | k. A. | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 148.436 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.290 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,71 | k. A. | k. A. |
| Ausschüttende A-Anteile | € 1.999 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 200 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,99 | k. A. | k. A. |
| Administrative Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 973.600 | $ 386.428 | $ 277.577 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 91.126 | 35.567 | 26.187 |
| NIW je Anteil | $ 10,68 | $ 10,86 | $ 10,60 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.593 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 160 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,97 | k. A. | k. A. |
| Administrative SGD (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD 190.840 | SGD 132.837 | SGD 159.620 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.740 | 12.239 | 15.062 |
| NIW je Anteil | SGD 10,75 | SGD 10,85 | SGD 10,60 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.385.004 | $ 876.309 | $ 413.735 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 115.802 | 74.733 | 37.498 |
| NIW je Anteil | $ 11,96 | $ 11,73 | $ 11,03 |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.244.643 | $ 1.308.714 | $ 982.691 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 212.856 | 121.523 | 93.141 |
| NIW je Anteil | $ 10,55 | $ 10,77 | $ 10,55 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 28.343 | CHF 12.475 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.716 | 1.203 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,43 | CHF 10,37 | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | CHF 45.599 | CHF 31.492 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.700 | 3.138 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,70 | CHF 10,03 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.274.386 | € 981.423 | € 260.591 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 107.313 | 84.006 | 23.695 |
| NIW je Anteil | € 11,87 | € 11,68 | € 11,00 |
| Ausschüttende Anteile | € 834.591 | € 504.476 | € 166.785 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 79.696 | 47.003 | 15.857 |
| NIW je Anteil | € 10,47 | € 10,73 | € 10,52 |
| Class E HKD (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | HKD 443.649 | HKD 306.623 | HKD 389.223 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 45.059 | 30.481 | 39.500 |
| NIW je Anteil | HKD 9,84 | HKD 10,06 | HKD 9,85 |
| Class E RMB (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | CNH 109.529 | CNH 241.537 | CNH 98.485 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.064 | 2.376 | 1.005 |
| NIW je Anteil | CNH 102,96 | CNH 101,66 | CNH 98,03 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD 291.985 | SGD 218.062 | SGD 54.405 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29.612 | 21.823 | 5.562 |
| NIW je Anteil | SGD 9,86 | SGD 9,99 | SGD 9,80 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 741 | € 237 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 72 | 23 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,25 | € 10,41 | k. A. |
| Class R: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 896 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 92 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,72 | k. A. | k. A. |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 21.369 | £ 3.255 | £ 2.593 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.973 | 297 | 244 |
| NIW je Anteil | £ 10,83 | £ 10,96 | £ 10,63 |
| Class S EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.252 | € 8 | € 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 114 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 11,00 | € 10,72 | € 10,00 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 14.804 | $ 16 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.466 | 2 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,10 | $ 9,94 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 7.866 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 819 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,60 | $ 9,84 | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 11.048 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.096 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,08 | € 9,96 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 12.480 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.302 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,58 | € 9,86 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 237.793 | $ 257.617 | $ 134.680 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.042 | 21.349 | 12.035 |
| NIW je Anteil | $ 12,49 | $ 12,07 | $ 11,19 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD 349 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 9,90 | k. A. | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Inflation Strategy Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 56.293 | $ 70.593 | $ 46.120 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 27.916 | $ 49.172 | $ 42.297 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.207 | 5.162 | 4.655 |
| NIW je Anteil | $ 8,70 | $ 9,53 | $ 9,09 |
| Institutional EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 2.165 | € 50 | € 22 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 237 | 5 | 2 |
| NIW je Anteil | € 9,14 | € 9,78 | € 9,03 |
| Institutional GBP (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 4.230 | £ 3.703 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 462 | 376 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,16 | £ 9,86 | k. A. |
| Investor EUR (Partially Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.365 | € 1.457 | € 1.350 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 152 | 151 | 151 |
| NIW je Anteil | € 8,98 | € 9,64 | € 8,94 |
| Ausschüttende Anteile | € 7 | € 7 | € 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 8,82 | € 9,57 | € 8,93 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 4.606 | $ 2.901 | $ 594 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 548 | 312 | 66 |
| NIW je Anteil | $ 8,40 | $ 9,31 | $ 8,99 |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.095 | $ 2.426 | $ 82 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 250 | 261 | 9 |
| NIW je Anteil | $ 8,37 | $ 9,30 | $ 8,99 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 5.182 | € 3.777 | € 535 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 591 | 398 | 60 |
| NIW je Anteil | € 8,77 | € 9,50 | € 8,88 |
| Ausschüttende Anteile | € 5.496 | € 3.237 | € 371 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 629 | 341 | 42 |
| NIW je Anteil | € 8,74 | € 9,49 | € 8,88 |
| **Low Average Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.541.553 | $ 2.058.153 | $ 4.255.625 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 659.949 | $ 788.850 | $ 1.051.280 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.613 | 53.684 | 72.491 |
| NIW je Anteil | $ 14,79 | $ 14,69 | $ 14,50 |
| Ausschüttende Anteile | $ 198.039 | $ 192.174 | $ 387.465 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.742 | 17.970 | 36.185 |
| NIW je Anteil | $ 10,57 | $ 10,69 | $ 10,71 |
| Institutional AUD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | AUD 10.028 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.000 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,03 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 188.426 | € 162.069 | € 378.021 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.926 | 15.464 | 36.513 |
| NIW je Anteil | € 10,51 | € 10,48 | € 10,35 |
| Ausschüttende Anteile | € 6.704 | € 71.842 | € 255.011 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 777 | 8.200 | 29.028 |
| NIW je Anteil | € 8,62 | € 8,76 | € 8,78 |
| Income II Shares | k. A. | k. A. | € 249.797 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 24.936 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,02 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Low Average Duration Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 61.847 | £ 198.517 | £ 181.709 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.046 | 19.213 | 17.619 |
| NIW je Anteil | £ 10,23 | £ 10,33 | £ 10,31 |
| Institutional ILS (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | ILS 74 | ILS 4.069 | ILS 19.708 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6 | 355 | 1.749 |
| NIW je Anteil | ILS 11,46 | ILS 11,45 | ILS 11,27 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 93.032 | $ 125.480 | $ 211.296 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.545 | 8.855 | 15.055 |
| NIW je Anteil | $ 14,21 | $ 14,17 | $ 14,04 |
| Ausschüttende Anteile | $ 5.618 | $ 14.059 | $ 21.567 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 536 | 1.325 | 2.031 |
| NIW je Anteil | $ 10,48 | $ 10,61 | $ 10,62 |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | £ 148 | £ 3.464 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 14 | 331 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 10,59 | £ 10,46 |
| Administrative Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 16.606 | $ 15.787 | $ 125.077 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.187 | 1.131 | 9.032 |
| NIW je Anteil | $ 13,99 | $ 13,96 | $ 13,85 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 97.360 | $ 144.872 | $ 209.157 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.996 | 11.870 | 17.208 |
| NIW je Anteil | $ 12,18 | $ 12,20 | $ 12,15 |
| Ausschüttende Anteile | $ 61.224 | $ 57.962 | $ 72.305 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.602 | 5.240 | 6.529 |
| NIW je Anteil | $ 10,93 | $ 11,06 | $ 11,08 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 76.770 | € 95.706 | € 457.922 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.462 | 10.484 | 50.296 |
| NIW je Anteil | € 9,07 | € 9,13 | € 9,10 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 5.173 | $ 1.344 | $ 8.747 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 459 | 120 | 790 |
| NIW je Anteil | $ 11,26 | $ 11,20 | $ 11,08 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 8.585 | $ 7.125 | $ 6.990 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 849 | 707 | 701 |
| NIW je Anteil | $ 10,12 | $ 10,08 | $ 9,98 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.822 | € 498 | € 890 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 182 | 50 | 89 |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 10,04 | € 9,95 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 95 | £ 141 | £ 407 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10 | 14 | 41 |
| NIW je Anteil | £ 9,82 | £ 9,91 | £ 9,89 |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 12 | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,34 | $ 10,40 | $ 10,34 |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 83.027 | $ 8.336 | |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 52.098 | $ 2.120 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.105 | 209 | |
| NIW je Anteil | $ 10,21 | $ 10,14 | |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | |
|---|---|---|---|---|
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)** | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 10 | $ | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 9,92 | $ | 10,00 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | CHF | 891 | CHF | 898 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 89 | | 89 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,03 | CHF | 10,12 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 13.426 | € | 732 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.321 | | 72 |
| NIW je Anteil | € | 10,16 | € | 10,14 |
| Ausschüttende Anteile | € | 10 | € | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | € | 9,86 | € | 9,99 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | £ | 6.709 | £ | 589 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 654 | | 58 |
| NIW je Anteil | £ | 10,26 | £ | 10,17 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 40 | £ | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4 | | 1 |
| NIW je Anteil | £ | 9,94 | £ | 10,02 |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ | 685 | $ | 441 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 68 | | 44 |
| NIW je Anteil | $ | 10,04 | $ | 10,07 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 4.406 | € | 2.489 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 441 | | 247 |
| NIW je Anteil | € | 9,99 | € | 10,06 |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | £ | 10 | £ | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | £ | 9,94 | £ | 10,02 |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | | | |
| Nettovermögen | $ | 70.458 | $ | 77.471 |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | $ | 2.670 | $ | 2.763 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 388 | | 299 |
| NIW je Anteil | $ | 6,88 | $ | 9,24 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 60.928 | $ | 72.874 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.357 | | 7.884 |
| NIW je Anteil | $ | 6,51 | $ | 9,24 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 712 | € | 355 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 104 | | 38 |
| NIW je Anteil | € | 6,85 | € | 9,24 |
| Ausschüttende Anteile | € | 1.139 | € | 355 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 176 | | 38 |
| NIW je Anteil | € | 6,48 | € | 9,24 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | £ | 730 | £ | 281 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 107 | | 30 |
| NIW je Anteil | £ | 6,83 | £ | 9,24 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 2.487 | £ | 281 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 385 | | 30 |
| NIW je Anteil | £ | 6,46 | £ | 9,24 |
| Investor Class: Thesaurierende Anteile | $ | 7 | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 6,85 | $ | 9,24 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | |
|---|---|---|---|---|
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)** | | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ | 7 | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 6,49 | $ | 9,24 |
| Investor EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 5 | € | 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | € | 6,82 | € | 9,24 |
| Ausschüttende Anteile | € | 39 | € | 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6 | | 1 |
| NIW je Anteil | € | 6,46 | € | 9,24 |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ | 7 | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 6,79 | $ | 9,23 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 7 | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 6,42 | $ | 9,23 |
| Income II Shares | $ | 7 | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 6,42 | $ | 9,23 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 5 | € | 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | € | 6,76 | € | 9,23 |
| Ausschüttende Anteile | € | 5 | € | 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | € | 6,39 | € | 9,23 |
| Class R GBP (Hedged): Thesaurierende Anteile | £ | 4 | £ | 6 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | £ | 6,82 | £ | 9,24 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 4 | £ | 6 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | £ | 6,44 | £ | 9,24 |
| **PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund** | | | | |
| Nettovermögen | $ | 7.674 | | |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | $ | 7.620 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 993 | | |
| NIW je Anteil | $ | 7,67 | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 7 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | |
| NIW je Anteil | € | 7,87 | | |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: Thesaurierende Anteile | £ | 5 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | |
| NIW je Anteil | £ | 8,19 | | |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ | 8 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ | 7,64 | | |
| Class E EUR (Unhedged): Thesaurierende Anteile | € | 7 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | |
| NIW je Anteil | € | 7,84 | | |
| Class R GBP (Unhedged): Thesaurierende Anteile | £ | 5 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | | |
| NIW je Anteil | £ | 8,18 | | |

| | Zum 31. Dez. 2015 |
|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental Emerging Markets Fund (Forts.)** | |
| Class T: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 8 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 7,63 |
| Class T EUR (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | € 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | € 7,82 |

| | |
|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental Europe Fund** | |
| Nettovermögen | € 28.358 |
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | € 28.295 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.035 |
| NIW je Anteil | € 9,32 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | £ 6 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | £ 9,70 |
| Institutional USD (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,09 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | € 13 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,28 |
| Class E USD (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,05 |
| Class R GBP (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | £ 6 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | £ 9,69 |
| Class T: | |
| Thesaurierende Anteile | € 8 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,27 |
| Class T USD (Unhedged): | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,03 |

| | |
|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund** | |
| Nettovermögen | $ 9.565 |
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9.233 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 993 |
| NIW je Anteil | $ 9,30 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | £ 162 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16 |
| NIW je Anteil | £ 9,92 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | € 38 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 |
| NIW je Anteil | € 9,54 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 14 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 |
| NIW je Anteil | $ 9,26 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental Global Developed Fund (Forts.)** | | | |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | € 9,50 | | |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 6 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | £ 9,91 | | |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,24 | | |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | € 9,48 | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental PLUS Emerging Markets Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 29.211 | $ 88.240 | $ 186.978 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 4.242 | $ 6.982 | $ 10.230 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 536 | 659 | 953 |
| NIW je Anteil | $ 7,92 | $ 10,59 | $ 10,74 |
| Ausschüttende Anteile | $ 8 | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 7,89 | $ 10,59 | $ 10,74 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 21.114 | € 65.139 | € 20 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.201 | 5.653 | 2 |
| NIW je Anteil | € 9,59 | € 11,52 | € 10,26 |
| Ausschüttende Anteile | € 79 | € 101 | € 28.352 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | 9 | 2.765 |
| NIW je Anteil | € 9,53 | € 11,51 | € 10,25 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 52 | £ 77 | £ 32 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6 | 7 | 3 |
| NIW je Anteil | £ 8,35 | £ 10,55 | £ 10,07 |
| Ausschüttende Anteile | £ 8 | £ 11 | £ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 8,31 | £ 10,55 | £ 10,07 |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 50 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,78 | k. A. | k. A. |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.652 | € 1.792 | € 99.838 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 188 | 167 | 10.322 |
| NIW je Anteil | € 8,81 | € 10,72 | € 9,67 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 804.936 | $ 1.087.748 | $ 197.859 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 4.966 | $ 6.505 | $ 5.621 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 464 | 553 | 493 |
| NIW je Anteil | $ 10,71 | $ 11,75 | $ 11,40 |
| Ausschüttende Anteile | $ 275 | $ 243 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26 | 21 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,59 | $ 11,73 | $ 11,40 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 157.184 | € 153.235 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.791 | 15.307 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,36 | € 10,01 | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS Global Developed Fund (Forts.) | | |
| Income II Shares | € 131.307 | € 175.781 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.145 | 17.377 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,28 | € 10,12 | k. A. |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 53 | € 882 | € 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | 69 | 1 |
| NIW je Anteil | € 12,97 | € 12,78 | € 10,88 |
| Ausschüttende Anteile | € 13 | € 13 | € 30.754 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 2.826 |
| NIW je Anteil | € 12,86 | € 12,75 | € 10,88 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 73 | £ 328 | £ 13 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6 | 28 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 11,29 | £ 11,71 | £ 10,69 |
| Ausschüttende Anteile | £ 11 | £ 12 | £ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 11,19 | £ 11,68 | £ 10,69 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,73 | $ 10,72 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,71 | $ 10,71 | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,63 | $ 10,70 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,62 | $ 10,70 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 445.025 | € 561.262 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 48.503 | 56.468 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,18 | € 9,94 | k. A. |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 2.279 | € 1.661 | € 108.703 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 186 | 136 | 10.324 |
| NIW je Anteil | € 12,23 | € 12,20 | € 10,53 |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 152 | € 44 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13 | 4 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 11,65 | € 11,51 | k. A. |

| | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund | | |
|---|---|---|---|
| Nettovermögen | $ 294.114 | $ 429.110 | $ 87.029 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 223.957 | $ 221.534 | $ 86.954 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.510 | 17.408 | 7.727 |
| NIW je Anteil | $ 12,10 | $ 12,73 | $ 11,25 |
| Ausschüttende Anteile | $ 771 | $ 13 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 65 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 11,90 | $ 12,72 | $ 11,25 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 8.272 | € 171.309 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 800 | 15.741 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,34 | € 10,88 | k. A. |
| Income II Shares | € 12.536 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.348 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,30 | k. A. | k. A. |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE Fundamental PLUS US Fund (Forts.) | | |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 30 | € 105 | € 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 8 | 1 |
| NIW je Anteil | € 14,68 | € 13,87 | € 10,74 |
| Ausschüttende Anteile | € 15 | € 14 | € 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 14,45 | € 13,83 | € 10,74 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 15 | £ 21 | £ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 2 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 12,74 | £ 12,67 | £ 10,55 |
| Ausschüttende Anteile | £ 13 | £ 13 | £ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 12,58 | £ 12,67 | £ 10,55 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 11 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,50 | $ 11,09 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 11 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,42 | $ 11,09 | k. A. |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 88 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,39 | $ 11,06 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | $ 31 | $ 11 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,38 | $ 11,06 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 42.762 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.515 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,47 | € 10,11 | k. A. |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 41 | € 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 12,99 | € 12,43 | k. A. |
| Class G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 45 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,74 | k. A. | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 7 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,74 | € 10,42 | k. A. |

| | PIMCO RAE Fundamental US Fund |
|---|---|
| Nettovermögen | $ 12.870 |
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 12.802 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.328 |
| NIW je Anteil | $ 9,64 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | € 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,88 |
| Institutional GBP (Unhedged) Class: | |
| Thesaurierende Anteile | £ 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | £ 10,28 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,59 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31.Dez. 2014 | Zum 31.Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Fundamental US Fund (Forts.)** | | | |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | € 9,84 | | |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 7 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | £ 10,27 | | |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 10 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,58 | | |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | € 9,82 | | |
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 299.750 | $ 325.692 | $ 300.756 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 185.353 | $ 188.262 | $ 189.702 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.985 | 14.690 | 15.410 |
| NIW je Anteil | $ 12,37 | $ 12,82 | $ 12,31 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 100.872 | € 90.999 | € 60.467 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.183 | 8.833 | 6.105 |
| NIW je Anteil | € 9,91 | € 10,30 | € 9,91 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 81 | NOK 154.127 | NOK 146.305 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1.544 | 1.543 |
| NIW je Anteil | NOK 97,02 | NOK 99,82 | NOK 94,81 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 3.524 | € 4.821 | € 2.611 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 322 | 422 | 237 |
| NIW je Anteil | € 10,94 | € 11,42 | € 11,02 |
| Investor NOK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK 5.725 | NOK 6.435 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 57 | 62 | k. A. |
| NIW je Anteil | NOK 100,84 | NOK 104,11 | k. A. |
| Investor SEK (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK 2.826 | SEK 535 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 5 | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 98,60 | SEK 104,21 | k. A. |
| **StocksPLUS™ Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.139.070 | $ 1.309.528 | $ 270.284 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 869.658 | $ 684.925 | $ 97.041 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 37.705 | 29.801 | 4.791 |
| NIW je Anteil | $ 23,07 | $ 22,98 | $ 20,26 |
| Ausschüttende Anteile | $ 32.291 | $ 35.107 | $ 67.110 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.893 | 2.056 | 4.439 |
| NIW je Anteil | $ 17,06 | $ 17,08 | $ 15,12 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 33.949 | € 82.344 | € 10.703 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.213 | 5.385 | 794 |
| NIW je Anteil | € 15,34 | € 15,29 | € 13,47 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **StocksPLUS™ Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 4.953 | € 3.950 | € 472 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 364 | 290 | 39 |
| NIW je Anteil | € 13,59 | € 13,61 | € 12,04 |
| Income II Shares | k. A. | € 72.449 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 6.909 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,49 | k. A. |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 3.359 | $ 4.467 | $ 1.449 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 154 | 205 | 75 |
| NIW je Anteil | $ 21,79 | $ 21,79 | $ 19,27 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 66.235 | $ 58.896 | $ 41.831 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.118 | 2.758 | 2.203 |
| NIW je Anteil | $ 21,24 | $ 21,36 | $ 18,99 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | € 189.360 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 16.900 | k. A. |
| NIW je Anteil | k. A. | € 11,20 | k. A. |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | k. A. | $ 13 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 13,37 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 100 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,33 | € 10,44 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 125.160 | $ 104.902 | $ 47.441 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.544 | 4.640 | 2.370 |
| NIW je Anteil | $ 22,58 | $ 22,61 | $ 20,02 |
| **Strategic Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 180.958 | $ 71.490 | $ 5.119 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.471 | $ 1.558 | $ 994 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 138 | 143 | 97 |
| NIW je Anteil | $ 10,63 | $ 10,90 | $ 10,24 |
| Income II Shares | $ 1.112 | $ 1.057 | $ 994 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 113 | 100 | 97 |
| NIW je Anteil | $ 9,87 | $ 10,54 | $ 10,24 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 60.631 | € 5.176 | € 1.107 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.608 | 468 | 108 |
| NIW je Anteil | € 10,81 | € 11,05 | € 10,24 |
| Income II Shares | € 1.168 | € 1.194 | € 1.107 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 116 | 112 | 108 |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 10,68 | € 10,24 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 11 | $ 11 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,55 | $ 10,86 | $ 10,24 |
| Income II Shares | $ 11 | $ 11 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,86 | $ 10,52 | $ 10,24 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Strategic Income Fund (Forts.)** | | | |
| Administrative Class: | | | |
| Income II Shares | $ 11 | $ 11 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,83 | $ 10,51 | $ 10,24 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 18.297 | $ 9.428 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.753 | 873 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,44 | $ 10,80 | $ 10,24 |
| Income II Shares | $ 7.903 | $ 5.308 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 815 | 508 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,69 | $ 10,45 | $ 10,24 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 48.953 | € 20.914 | € 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.612 | 1.911 | 1 |
| NIW je Anteil | € 10,61 | € 10,94 | € 10,24 |
| Income II Shares | € 28.199 | € 17.406 | € 7 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.861 | 1.644 | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,86 | € 10,59 | € 10,24 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | € 10 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,91 | k. A. | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 555 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 57 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,74 | € 10,09 | k. A. |
| Ausschüttende Anteile | € 531 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 56 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,51 | € 10,03 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Income II Shares | $ 11 | $ 11 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,09 | $ 10,65 | $ 10,25 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 7.221.128 | $ 10.417.358 | $ 21.368.184 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.568.939 | $ 1.987.342 | $ 3.409.065 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 57.906 | 73.865 | 131.981 |
| NIW je Anteil | $ 27,09 | $ 26,90 | $ 25,83 |
| Ausschüttende Anteile | $ 189.095 | $ 415.460 | $ 744.408 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.595 | 25.119 | 45.975 |
| NIW je Anteil | $ 16,31 | $ 16,54 | $ 16,19 |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | CAD 56.768 | CAD 241.292 | CAD 173.127 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.810 | 24.460 | 18.080 |
| NIW je Anteil | CAD 9,77 | CAD 9,86 | CAD 9,58 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 12.705 | CHF 14.498 | CHF 26.668 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.170 | 1.324 | 2.530 |
| NIW je Anteil | CHF 10,86 | CHF 10,95 | CHF 10,54 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 433.846 | € 671.031 | € 1.356.809 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.805 | 32.270 | 67.847 |
| NIW je Anteil | € 20,85 | € 20,79 | € 19,99 |
| Ausschüttende Anteile | € 133.731 | € 93.353 | € 66.305 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.939 | 6.125 | 4.436 |
| NIW je Anteil | € 14,96 | € 15,24 | € 14,95 |
| Income II Shares | k. A. | € 416 | € 25.852 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 41 | 2.601 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,09 | € 9,94 |
| Institutional EUR (Unhedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 64.051 | € 45.851 | € 37.581 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.569 | 2.063 | 2.007 |
| NIW je Anteil | € 24,93 | € 22,22 | € 18,73 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 20.152 | £ 18.185 | £ 25.903 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.639 | 1.494 | 2.225 |
| NIW je Anteil | £ 12,30 | £ 12,18 | £ 11,65 |
| Ausschüttende Anteile | £ 72.093 | £ 108.159 | £ 169.306 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.355 | 10.908 | 17.492 |
| NIW je Anteil | £ 9,80 | £ 9,92 | £ 9,68 |
| Institutional ILS (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | ILS 12.615 | ILS 11.488 | ILS 104.342 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.015 | 929 | 8.793 |
| NIW je Anteil | ILS 12,43 | ILS 12,37 | ILS 11,87 |
| Institutional JPY (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | JPY 1.563.463 | JPY 1.561.236 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.549 | 1.549 | k. A. |
| NIW je Anteil | JPY 1.009,00 | JPY 1.008,00 | k. A. |
| Institutional SGD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | SGD 28.234 | SGD 32.269 | SGD 49.807 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.429 | 2.818 | 4.527 |
| NIW je Anteil | SGD 11,62 | SGD 11,45 | SGD 11,00 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 542.054 | $ 641.592 | $ 1.784.274 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.260 | 25.253 | 72.895 |
| NIW je Anteil | $ 25,50 | $ 25,41 | $ 24,48 |
| Ausschüttende Anteile | $ 101.367 | $ 150.075 | $ 312.771 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.129 | 8.946 | 19.044 |
| NIW je Anteil | $ 16,54 | $ 16,78 | $ 16,42 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 10.798 | CHF 10.973 | CHF 51.374 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.010 | 1.015 | 4.914 |
| NIW je Anteil | CHF 10,69 | CHF 10,81 | CHF 10,45 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 108.466 | € 146.200 | € 335.430 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.404 | 7.279 | 17.310 |
| NIW je Anteil | € 20,07 | € 20,08 | € 19,38 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 126 | € | 128 | € | 198 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13 | | 13 | | 21 |
| NIW je Anteil | € | 9,69 | € | 9,86 | € | 9,66 |
| Investor GBP (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | £ | 4.508 | £ | 4.311 | £ | 18.199 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 403 | | 388 | | 1.707 |
| NIW je Anteil | £ | 11,18 | £ | 11,11 | £ | 10,66 |
| Investor SGD (Hedged) Class: Ausschüttende Anteile | | k. A. | SGD | 489 | SGD | 887 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 50 | | 92 |
| NIW je Anteil | | k. A. | SGD | 9,83 | SGD | 9,63 |
| Administrative Class: Thesaurierende Anteile | $ | 458.626 | $ | 632.022 | $ | 972.138 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 18.028 | | 24.894 | | 39.685 |
| NIW je Anteil | $ | 25,44 | $ | 25,39 | $ | 24,50 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 7.904 | € | 8.961 | € | 18.793 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 653 | | 739 | | 1.603 |
| NIW je Anteil | € | 12,10 | € | 12,13 | € | 11,72 |
| Class E: Thesaurierende Anteile | $ | 849.647 | $ | 1.197.039 | $ | 2.320.214 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 34.240 | | 48.145 | | 96.332 |
| NIW je Anteil | $ | 24,81 | $ | 24,86 | $ | 24,08 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 342.983 | $ | 477.238 | $ | 934.761 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.637 | | 37.912 | | 75.848 |
| NIW je Anteil | $ | 12,41 | $ | 12,59 | $ | 12,32 |
| Class E CHF (Hedged): Thesaurierende Anteile | CHF | 7.324 | CHF | 10.399 | CHF | 39.233 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 743 | | 1.038 | | 4.028 |
| NIW je Anteil | CHF | 9,85 | CHF | 10,02 | CHF | 9,74 |
| Class E EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 1.596.294 | € | 2.285.212 | € | 4.286.541 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 83.515 | | 118.818 | | 229.648 |
| NIW je Anteil | € | 19,11 | € | 19,23 | € | 18,66 |
| Ausschüttende Anteile | € | 157.998 | € | 255.326 | € | 498.565 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 15.841 | | 25.132 | | 50.032 |
| NIW je Anteil | € | 9,97 | € | 10,16 | € | 9,96 |
| Class E HKD (Unhedged): Thesaurierende Anteile | HKD | 763 | HKD | 2.426 | HKD | 5.391 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 76 | | 241 | | 552 |
| NIW je Anteil | HKD | 10,06 | HKD | 10,08 | HKD | 9,76 |
| Class E SGD (Hedged): Thesaurierende Anteile | SGD | 58.276 | SGD | 80.319 | SGD | 160.220 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.580 | | 2.190 | | 4.507 |
| NIW je Anteil | SGD | 36,89 | SGD | 36,67 | SGD | 35,55 |
| Ausschüttende Anteile | SGD | 2.479 | SGD | 3.111 | SGD | 12.779 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 252 | | 314 | | 1.315 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,86 | SGD | 9,92 | SGD | 9,72 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | € | 23 | € | 10 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2 | | 1 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 10,15 | € | 10,21 | | k. A. |
| Class G Retail EUR (Hedged): Ausschüttende Anteile | | k. A. | € | 167 | € | 401 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 16 | | 39 |
| NIW je Anteil | | k. A. | € | 10,39 | € | 10,17 |
| Class H Institutional: Thesaurierende Anteile | $ | 118.392 | $ | 93.780 | $ | 394.537 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.457 | | 3.549 | | 15.524 |
| NIW je Anteil | $ | 26,57 | $ | 26,43 | $ | 25,41 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | | | | | |
| Class M Retail HKD (Unhedged): Ausschüttende Anteile | HKD | 3.618 | HKD | 18.291 | HKD | 16.885 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 371 | | 1.849 | | 1.744 |
| NIW je Anteil | HKD | 9,75 | HKD | 9,89 | HKD | 9,68 |
| Class R: Thesaurierende Anteile | $ | 5.426 | $ | 9.583 | $ | 14.982 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 531 | | 943 | | 1.531 |
| NIW je Anteil | $ | 10,21 | $ | 10,16 | $ | 9,78 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 637 | $ | 679 | $ | 3.330 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 66 | | 69 | | 346 |
| NIW je Anteil | $ | 9,70 | $ | 9,84 | $ | 9,63 |
| Class R EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 4.882 | € | 4.233 | € | 2.085 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 483 | | 418 | | 214 |
| NIW je Anteil | € | 10,12 | € | 10,12 | € | 9,75 |
| Class R GBP (Hedged): Ausschüttende Anteile | £ | 1.006 | £ | 1.429 | £ | 3.693 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 103 | | 145 | | 385 |
| NIW je Anteil | £ | 9,75 | £ | 9,86 | £ | 9,62 |
| Class S: Thesaurierende Anteile | $ | 20.149 | $ | 5.308 | $ | 395.067 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.934 | | 513 | | 39.768 |
| NIW je Anteil | $ | 10,42 | $ | 10,35 | $ | 9,93 |
| Class S EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 2.430 | € | 1.727 | € | 22.320 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 235 | | 167 | | 2.247 |
| NIW je Anteil | € | 10,36 | € | 10,33 | € | 9,93 |
| Class T: Thesaurierende Anteile | $ | 1.708 | $ | 51 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 171 | | 5 | | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 9,98 | $ | 10,03 | | k. A. |
| Class T EUR (Hedged): Thesaurierende Anteile | € | 427 | € | 28 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 43 | | 3 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 10,01 | € | 10,10 | | k. A. |
| Class Z: Ausschüttende Anteile | $ | 14 | $ | 14 | $ | 56.254 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2 | | 2 | | 6.268 |
| NIW je Anteil | $ | 9,11 | $ | 9,18 | $ | 8,97 |

| | | |
|---|---|---|
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Nettovermögen | $ | 21.109 |
| Institutional Class: Thesaurierende Anteile | $ | 2.061 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 219 |
| NIW je Anteil | $ | 9,41 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 |
| NIW je Anteil | $ | 9,40 |
| Institutional CHF (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | CHF | 111 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12 |
| NIW je Anteil | CHF | 9,35 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: Thesaurierende Anteile | € | 16.892 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.801 |
| NIW je Anteil | € | 9,38 |
| Ausschüttende Anteile | | € 36 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4 |
| NIW je Anteil | € | 9,36 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 51 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | | |
| NIW je Anteil | £ 9,41 | | |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,40 | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,40 | | |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 36 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | | |
| NIW je Anteil | € 9,36 | | |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,36 | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,36 | | |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 110 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12 | | |
| NIW je Anteil | CHF 9,29 | | |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 36 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | | |
| NIW je Anteil | € 9,33 | | |
| Ausschüttende Anteile | € 36 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | | |
| NIW je Anteil | € 9,33 | | |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 51 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | | |
| NIW je Anteil | £ 9,37 | | |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | | |
| NIW je Anteil | $ 9,41 | | |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 36 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | | |
| NIW je Anteil | € 9,38 | | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 51 | | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | | |
| NIW je Anteil | £ 9,41 | | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **UK Corporate Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | £ 249.972 | £ 314.384 | £ 372.072 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 249.972 | £ 314.384 | £ 372.072 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.573 | 18.500 | 24.715 |
| NIW je Anteil | £ 17,15 | £ 16,99 | £ 15,05 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | £ 572.664 | £ 897.653 | £ 984.628 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 411.633 | £ 541.043 | £ 651.543 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.687 | 28.588 | 40.846 |
| NIW je Anteil | £ 18,98 | £ 18,93 | £ 15,95 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 161.031 | £ 356.610 | £ 333.085 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.898 | 25.400 | 26.991 |
| NIW je Anteil | £ 13,53 | £ 14,04 | £ 12,34 |
| **UK Low Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | £ 168.432 | £ 182.247 | £ 104.147 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 159.576 | £ 162.238 | £ 98.919 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.353 | 11.572 | 7.252 |
| NIW je Anteil | £ 14,06 | £ 14,02 | £ 13,64 |
| Ausschüttende Anteile | £ 8.856 | £ 20.009 | £ 5.228 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 864 | 1.933 | 513 |
| NIW je Anteil | £ 10,25 | £ 10,35 | £ 10,20 |
| **UK Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | £ 16.259 | £ 50.504 | £ 60.008 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 13.013 | £ 39.639 | £ 41.899 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 587 | 1.744 | 2.234 |
| NIW je Anteil | £ 22,17 | £ 22,73 | £ 18,75 |
| Ausschüttende Anteile | £ 309 | £ 317 | £ 12.505 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18 | 18 | 841 |
| NIW je Anteil | £ 17,26 | £ 17,80 | £ 14,87 |
| Class E: | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 2.937 | £ 5.579 | £ 4.755 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 196 | 359 | 366 |
| NIW je Anteil | £ 15,01 | £ 15,54 | £ 12,99 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | k. A. | £ 4.969 | £ 849 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 220 | 46 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 22,56 | £ 18,64 |
| **UK Sterling Long Average Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | £ 16.066 | £ 20.763 | £ 27.048 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 13.592 | £ 17.844 | £ 23.492 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 638 | 827 | 1.367 |
| NIW je Anteil | £ 21,31 | £ 21,57 | £ 17,19 |
| Ausschüttende Anteile | £ 1.645 | £ 1.670 | £ 2.172 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 105 | 103 | 165 |
| NIW je Anteil | £ 15,72 | £ 16,15 | £ 13,18 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 829 | £ 1.249 | £ 1.384 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 40 | 59 | 82 |
| NIW je Anteil | £ 20,81 | £ 21,09 | £ 16,84 |
| **Unconstrained Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 3.008.947 | $ 5.350.068 | $ 12.454.085 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 830.225 | $ 1.444.194 | $ 2.312.005 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 69.871 | 118.821 | 194.591 |
| NIW je Anteil | $ 11,88 | $ 12,15 | $ 11,88 |
| Ausschüttende Anteile | $ 54.441 | $ 96.502 | $ 203.083 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.030 | 8.537 | 18.095 |
| NIW je Anteil | $ 10,82 | $ 11,30 | $ 11,22 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Institutional CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 81.207 | CHF | 89.829 | CHF | 149.564 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.957 | | 8.498 | | 14.425 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,21 | CHF | 10,57 | CHF | 10,36 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 282.736 | € | 654.218 | € | 1.320.687 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 23.833 | | 53.734 | | 110.828 |
| NIW je Anteil | € | 11,86 | € | 12,18 | € | 11,92 |
| Ausschüttende Anteile | € | 32.964 | € | 88.563 | € | 239.411 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.063 | | 7.849 | | 21.330 |
| NIW je Anteil | € | 10,76 | € | 11,28 | € | 11,22 |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ | 397.212 | £ | 515.167 | £ | 1.104.954 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 35.153 | | 44.678 | | 97.950 |
| NIW je Anteil | £ | 11,30 | £ | 11,53 | £ | 11,24 |
| Ausschüttende Anteile | £ | 30.440 | £ | 29.039 | £ | 62.126 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.070 | | 2.810 | | 6.074 |
| NIW je Anteil | £ | 9,92 | £ | 10,33 | £ | 10,23 |
| Institutional NOK (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | NOK | 584.797 | NOK | 304.321 | NOK | 420.006 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 52.679 | | 27.055 | | 38.709 |
| NIW je Anteil | NOK | 11,10 | NOK | 11,25 | NOK | 10,85 |
| Institutional SEK (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK | 750.147 | SEK | 734.754 | SEK | 613.941 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.693 | | 7.323 | | 6.283 |
| NIW je Anteil | SEK | 97,52 | SEK | 100,33 | SEK | 97,71 |
| Investor Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 74.340 | $ | 127.444 | $ | 304.824 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.220 | | 12.059 | | 29.402 |
| NIW je Anteil | $ | 10,30 | $ | 10,57 | $ | 10,37 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 13.483 | $ | 51.863 | $ | 123.968 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.393 | | 5.127 | | 12.345 |
| NIW je Anteil | $ | 9,68 | $ | 10,11 | $ | 10,04 |
| Investor CHF (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | | k. A. | CHF | 151 | CHF | 6.999 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 15 | | 718 |
| NIW je Anteil | | k. A. | CHF | 9,91 | CHF | 9,75 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 10.970 | € | 20.034 | € | 72.590 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.062 | | 1.882 | | 6.943 |
| NIW je Anteil | € | 10,33 | € | 10,64 | € | 10,45 |
| Ausschüttende Anteile | € | 754 | € | 1.191 | € | 7.384 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 81 | | 123 | | 765 |
| NIW je Anteil | € | 9,27 | € | 9,71 | € | 9,65 |
| Investor GBP (Hedged) Class: | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ | 610 | £ | 953 | £ | 3.840 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 61 | | 92 | | 375 |
| NIW je Anteil | £ | 9,94 | £ | 10,36 | £ | 10,25 |
| Administrative Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 23.276 | $ | 45.405 | $ | 147.776 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.018 | | 3.830 | | 12.690 |
| NIW je Anteil | $ | 11,53 | $ | 11,86 | $ | 11,64 |
| Administrative EUR (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 13.457 | € | 19.645 | € | 96.905 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.169 | | 1.654 | | 8.295 |
| NIW je Anteil | € | 11,51 | € | 11,88 | € | 11,68 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | | Zum 31. Dez. 2014 | | Zum 31. Dez. 2013 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Unconstrained Bond Fund (Forts.) | | | | | |
| Administrative SEK (Hedged) Class: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | SEK | 929.079 | SEK | 2.079.052 | SEK | 3.628.574 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 8.816 | | 19.078 | | 34.020 |
| NIW je Anteil | SEK | 105,39 | SEK | 108,98 | SEK | 106,66 |
| Class E: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 143.199 | $ | 264.517 | $ | 851.078 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.935 | | 24.938 | | 81.350 |
| NIW je Anteil | $ | 10,28 | $ | 10,61 | $ | 10,46 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 37.785 | $ | 81.038 | $ | 203.945 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.822 | | 7.848 | | 19.893 |
| NIW je Anteil | $ | 9,89 | $ | 10,33 | $ | 10,25 |
| Class E CHF (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF | 41.432 | CHF | 81.943 | CHF | 352.629 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 4.267 | | 8.076 | | 35.140 |
| NIW je Anteil | CHF | 9,71 | CHF | 10,15 | CHF | 10,04 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 287.226 | € | 505.091 | € | 1.460.567 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 25.569 | | 43.417 | | 127.664 |
| NIW je Anteil | € | 11,23 | € | 11,63 | € | 11,49 |
| Class E GBP (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ | 6.889 | £ | 11.280 | £ | 49.946 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 654 | | 1.040 | | 4.809 |
| NIW je Anteil | £ | 10,53 | £ | 10,84 | £ | 10,66 |
| Class E SGD (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | SGD | 451 | SGD | 881 | SGD | 8.139 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 48 | | 91 | | 846 |
| NIW je Anteil | SGD | 9,35 | SGD | 9,68 | SGD | 9,62 |
| Class G Institutional EUR (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 29 | € | 44 | | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3 | | 4 | | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 9,78 | € | 10,11 | | k. A. |
| Class G Retail EUR (Hedged): | | | | | | |
| Ausschüttende Anteile | € | 60.460 | € | 107.729 | € | 189.498 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 6.109 | | 10.440 | | 18.594 |
| NIW je Anteil | € | 9,90 | € | 10,32 | € | 10,19 |
| Class H Institutional: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | | k. A. | $ | 10 | $ | 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | | 1 | | 1 |
| NIW je Anteil | | k. A. | $ | 9,86 | $ | 9,66 |
| Class R: | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ | 10.181 | $ | 1.622 | $ | 1.860 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.043 | | 162 | | 190 |
| NIW je Anteil | $ | 9,76 | $ | 9,99 | $ | 9,77 |
| Ausschüttende Anteile | $ | 486 | $ | 595 | $ | 1.172 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 52 | | 61 | | 120 |
| NIW je Anteil | $ | 9,38 | $ | 9,80 | $ | 9,72 |
| Class R EUR (Hedged): | | | | | | |
| Thesaurierende Anteile | € | 2.618 | € | 2.356 | € | 2.177 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 270 | | 237 | | 223 |
| NIW je Anteil | € | 9,70 | € | 9,96 | € | 9,76 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **Unconstrained Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 487 | £ 742 | £ 1.785 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 50 | 74 | 182 |
| NIW je Anteil | £ 9,83 | £ 10,04 | £ 9,80 |
| Class S: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.877 | $ 1.784 | $ 26.353 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 190 | 176 | 2.664 |
| NIW je Anteil | $ 9,89 | $ 10,12 | $ 9,89 |
| Class S CHF (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | CHF 160 | CHF 116 | CHF 13.467 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16 | 11 | 1.362 |
| NIW je Anteil | CHF 9,73 | CHF 10,08 | CHF 9,89 |
| Class S EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 1.035 | € 1.732 | € 48.725 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 105 | 171 | 4.921 |
| NIW je Anteil | € 9,86 | € 10,12 | € 9,90 |
| Class T: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 214 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,64 | $ 9,98 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 10 | $ 59.719 | $ 187.896 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 5.754 | 18.238 |
| NIW je Anteil | $ 10,04 | $ 10,38 | $ 10,30 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | AUD 51.001 | AUD 46.371 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.133 | 4.557 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 9,94 | AUD 10,18 | k. A. |
| **US High Yield Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.983.875 | $ 1.782.726 | $ 2.263.996 |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 416.098 | $ 217.437 | $ 443.878 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.483 | 7.917 | 16.730 |
| NIW je Anteil | $ 26,87 | $ 27,46 | $ 26,53 |
| Ausschüttende Anteile | $ 199.172 | $ 171.219 | $ 108.745 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.695 | 17.278 | 10.764 |
| NIW je Anteil | $ 9,18 | $ 9,91 | $ 10,10 |
| Institutional CAD (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | CAD 1.469 | CAD 1.167 | CAD 1.599 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 115 | 90 | 128 |
| NIW je Anteil | CAD 12,79 | CAD 13,03 | CAD 12,49 |
| Institutional EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 232.063 | € 136.043 | € 172.337 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.821 | 5.611 | 7.353 |
| NIW je Anteil | € 23,63 | € 24,25 | € 23,44 |
| Ausschüttende Anteile | € 165.540 | € 168.170 | € 183.871 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.676 | 12.808 | 13.717 |
| NIW je Anteil | € 12,10 | € 13,13 | € 13,40 |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 | Zum 31. Dez. 2013 |
|---|---|---|---|
| **US High Yield Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional GBP (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | £ 265.326 | £ 221.485 | £ 193.497 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.455 | 12.624 | 11.443 |
| NIW je Anteil | £ 17,17 | £ 17,55 | £ 16,91 |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 147.757 | $ 198.738 | $ 249.180 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.010 | 7.882 | 10.194 |
| NIW je Anteil | $ 24,59 | $ 25,21 | $ 24,44 |
| Ausschüttende Anteile | $ 22.330 | $ 37.086 | $ 67.634 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.009 | 4.630 | 8.280 |
| NIW je Anteil | $ 7,42 | $ 8,01 | $ 8,17 |
| Investor EUR (Hedged) Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 4.024 | € 7.276 | € 18.828 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 184 | 323 | 858 |
| NIW je Anteil | € 21,85 | € 22,50 | € 21,82 |
| Class E: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 101.168 | $ 100.733 | $ 121.446 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.107 | 3.965 | 4.904 |
| NIW je Anteil | $ 24,63 | $ 25,40 | $ 24,76 |
| Ausschüttende Anteile | $ 77.682 | $ 89.977 | $ 160.129 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.933 | 8.514 | 14.859 |
| NIW je Anteil | $ 9,79 | $ 10,57 | $ 10,78 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 42.189 | € 57.884 | € 78.769 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.951 | 2.585 | 3.621 |
| NIW je Anteil | € 21,63 | € 22,40 | € 21,84 |
| Class H Institutional: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 138.561 | $ 145.834 | $ 138.447 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.266 | 5.415 | 5.313 |
| NIW je Anteil | $ 26,31 | $ 26,93 | $ 26,06 |
| Class M Retail: | | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 2.624 | $ 23.186 | $ 19.097 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 264 | 2.164 | 1.748 |
| NIW je Anteil | $ 9,93 | $ 10,72 | $ 10,92 |
| Class R: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 1.367 | $ 1.704 | $ 72 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 126 | 154 | 7 |
| NIW je Anteil | $ 10,82 | $ 11,08 | $ 10,73 |
| Ausschüttende Anteile | $ 1.543 | $ 982 | $ 4.282 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 166 | 98 | 420 |
| NIW je Anteil | $ 9,28 | $ 10,02 | $ 10,21 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Thesaurierende Anteile | € 118 | € 74 | € 382 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11 | 7 | 36 |
| NIW je Anteil | € 10,72 | € 11,02 | € 10,68 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Ausschüttende Anteile | £ 818 | £ 1.553 | £ 1.789 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 88 | 155 | 175 |
| NIW je Anteil | £ 9,29 | £ 10,03 | £ 10,21 |
| **US Short-Term Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 632.048 | $ 383.185 | |
| Institutional Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 247.416 | $ 23.443 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.423 | 2.344 | |
| NIW je Anteil | $ 10,13 | $ 10,00 | |
| Investor Class: | | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 37.110 | $ 10 | |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.684 | 1 | |
| NIW je Anteil | $ 10,07 | $ 9,98 | |

| | Zum 31. Dez. 2015 | Zum 31. Dez. 2014 |
|---|---|---|
| | US Short-Term Fund (Forts.) | |
| Class E: | | |
| Thesaurierende Anteile | $ 3.257 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 323 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,07 | $ 9,98 |
| Class Z: | | |
| Ausschüttende Anteile | $ 344.265 | $ 359.722 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34.433 | 36.118 |
| NIW je Anteil | $ 10,00 | $ 9,96 |

| | US Small Cap StocksPLUS® Fund |
|---|---|
| Nettovermögen | $ 49.564 |
| Institutional Class: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 49.546 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.356 |
| NIW je Anteil | $ 9,25 |
| Investor Class: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,22 |
| Class E: | |
| Thesaurierende Anteile | $ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 |
| NIW je Anteil | $ 9,18 |

## 18. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

PIMCO hat von den Mitarbeitern der US Securities and Exchange Commission („SEC“) eine „Wells Notice“ erhalten. Diese bezieht sich auf den PIMCO Total Return Active Exchange-Traded Fund („BOND“), eine Serie des PIMCO ETF Trust. Die Mitteilung weist auf die vorläufige Feststellung der Mitarbeiter hin, der SEC auf Basis einer nicht öffentlichen Untersuchung in Bezug auf BOND empfehlen zu wollen, eine Zivilklage gegen PIMCO einzuleiten. Eine Wells Notice ist weder ein formeller Vorwurf von Fehlverhalten noch eine Feststellung, dass gegen ein Gesetz verstoßen wurde.

Diese Angelegenheit bezieht sich im Wesentlichen auf die Bewertung kleinerer Positionen bei Non-Agency-MBS, die BOND in der Zeit zwischen seiner Auflegung am 29. Februar 2012 und dem 30. Juni 2012 gekauft hatte, sowie auf die von BOND für diesen Zeitraum veröffentlichten Performanceangaben und auf PIMCOs Compliance-Richtlinien und -Verfahren im Zusammenhang mit diesen Angelegenheiten.

Der Wells-Prozess bietet PIMCO die Gelegenheit, den Mitarbeitern der SEC nachzuweisen, warum sein Verhalten seiner Ansicht nach angemessen war, den Branchenstandards entspricht und dass keine Klage eingereicht werden sollte. PIMCO ist der Ansicht, dass es unwahrscheinlich ist, dass diese Angelegenheit wesentliche negative Auswirkungen auf einen Teilfonds oder auf die Fähigkeit PIMCOs zur Bereitstellung von Anlageverwaltungsdiensten haben wird. Die vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts.

## 19. KREDITFAZILITÄT

Der US High Yield Bond Fund und der Global High Yield Bond Fund (die „Teilfonds“) haben am 28. August 2015 eine syndizierte Kreditfazilität zwischen u.a. den Teilfonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ, Ltd. („BTUFJ“) (als Kreditgeber) zählt, und BTUFJ (als Agent und Lead Arranger) abgeschlossen. Die Teilfonds dürfen die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß ihrer jeweiligen Anlagepolitik zulässig sind. Der maximale Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Teilfonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 299.000.000. Die Teilfonds können zusammen mit den anderen Kreditnehmern und vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung des insgesamt zur Inanspruchnahme verfügbaren Betrags um bis zu USD 125.000.000 beantragen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheiden die Teilfonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Die folgenden Zinssätze sind verfügbar: (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz), die 1,125 % über der am jeweiligen Feststellungstag geltenden Federal Funds Rate (US-Leitzins) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) liegt; und (ii) die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs), einem jährlichen Zinssatz, der dem Quotienten entspricht, der sich ergibt, wenn (a) der LIBOR Offered Rate (LIBOR-Briefkurs) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) durch (b) 1,00 abzüglich der Reserve Percentage (Reservesatz) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geteilt wird. Ein Kredit, der auf Basis der Alternate Base Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen. Ein Kredit, der auf Basis der Adjusted Offer Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen am letzten Tag eines maßgeblichen Zinszeitraums (dieser kann nach Wahl der Teilfonds einem Zeitraum von einer Woche, einem Monat oder zwei Monaten entsprechen) zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber den Teilfonds ist auf die Vermögenswerte der Teilfonds beschränkt.

Zum 31. Dezember 2015 hatten die Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung keine Kredite in Anspruch genommen.

## 20. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 22. Januar 2016 wurde der UK Real Return Fund geschlossen. Am 29. Januar 2016 wurde der Global Libor Plus Bond Fund aufgelegt, und am 25. Februar 2016 wurde der Dynamic Multi-Asset Fund aufgelegt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine Ereignisse zu verzeichnen.

## 21. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 26. April 2016 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat legt den Anteilinhabern den geprüften Jahresabschluss für das zum 31. Dezember 2015 endende Geschäftsjahr vor.

## VERANTWORTUNG DES VERWALTUNGSRATS

Der Verwaltungsrat ist für die Erstellung des Jahresberichts und des Abschlusses gemäß geltendem irischem Recht und den Generally Accepted Accounting Practices von Ireland, wozu auch die vom Financial Reporting Council herausgegebenen und vom Institute of Chartered Accountants in Ireland veröffentlichten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden zählen, verantwortlich.

Nach irischem Recht darf der Verwaltungsrat den Abschluss nur dann genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass dieser ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage des Fonds zum Ende des Geschäftsjahres und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft für das Geschäftsjahr widerspiegelt.

Bei der Erstellung des Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

- geeignete Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden auswählen und diese konsequent anwenden;
- vernünftige, vorsichtige Beurteilungen und Schätzungen vornehmen;
- angeben, ob der Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden Bilanzierungsgrundsätze erstellt wurde, die entsprechenden Standards identifizieren und wesentliche Abweichungen von diesen Richtlinien in den Erläuterungen zum Abschluss anzugeben und erläutern; und
- den Abschluss auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellen, es sei denn, es ist unangemessen, davon auszugehen, dass die Gesellschaft ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen wird.

Der Verwaltungsrat ist für die Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher verantwortlich, die ausreichend sind, um:

- die Transaktionen der Gesellschaft korrekt zu erfassen und zu erläutern;
- jederzeit die Ermittlung der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten, der Finanzlage und des Gewinns oder Verlusts der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermöglichen; und
- den Verwaltungsrat in die Lage zu versetzen, sicherzustellen, dass der Abschluss dem Companies Act von 2014 entspricht, und eine Prüfung dieses Abschlusses zu ermöglichen.

Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat für den Schutz des Vermögens der Gesellschaft und somit für das Ergreifen angemessener Maßnahmen verantwortlich, um Betrug und anderen Regelwidrigkeiten vorzubeugen und diese aufzudecken.

Der Verwaltungsrat ist für die Pflege und Integrität der Unternehmens- und Finanzinformationen auf der Website der Gesellschaft verantwortlich. Die Gesetzgebung Irlands, die die Erstellung und Verteilung der Abschlüsse regelt, kann sich von der Gesetzgebung anderer Rechtsräume unterscheiden.

## ERGEBNISSE, AKTIVITÄTEN UND ZUKÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

Die Betriebsergebnisse und festgesetzten Dividenden werden in der Betriebsergebnisrechnung auf den Seiten 96 bis 116 ausgewiesen. Die Seiten 6 bis 67 enthalten einen Überblick über die Entwicklung der Anlagen der Teilfonds und ihrer Portfolios.

## RISIKOMANAGEMENTZIELE UND -GRUNDSÄTZE

Einzelheiten zu den Risikomanagementzielen und -grundsätzen der Gesellschaft und dem Marktpreis-, Fremdwährungs-, Zins-, Liquiditäts- und Kredit- und Kontrahentenrisiko der Gesellschaft werden in Erläuterung 15 in den Erläuterungen zum Abschluss dargelegt.

## EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Am 22. Januar 2016 wurde der UK Real Return Fund geschlossen. Am 29. Januar 2016 wurde der Global Libor Plus Bond Fund aufgelegt, und am 26. Februar 2016 wurde der Dynamic Multi-Asset Fund aufgelegt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine Ereignisse zu verzeichnen.

## GESCHÄFTSBÜCHER

Die vom Verwaltungsrat ergriffenen Maßnahmen mit dem Ziel, die Erfüllung der Pflicht der Gesellschaft zur Führung ordnungsgemäßer Geschäftsbücher zu gewährleisten, umfassen den Einsatz geeigneter Systeme und Verfahren sowie den Einsatz kompetenter Personen. Die Geschäftsbücher werden bei Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited, 30 Herbert Street, Dublin 2, Irland aufbewahrt.

## CORPORATE GOVERNANCE

Die Gesellschaft unterliegt irischem Recht und ist mit diesem konform, einschließlich des Companies Acts von 2014, den Richtlinien der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung (Verordnung Nr. 352 von 2011) (die „OGAW-Richtlinien“) sowie den Regeln für die Notierung an der Irish Stock Exchange. Der Verwaltungsrat hat die Maßgaben geprüft, die in dem von der Irish Fund Industry Association im Dezember 2011 veröffentlichten freiwilligen Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies enthalten sind (der „IFIA Code“). Der Verwaltungsrat hat sämtliche Governance-Praktiken und -Verfahren des IFIA-Code IFIA Code angenommen.

Der Verwaltungsrat hat erklärt, dass die Maßnahmen im Code der IFIA mit seinen Corporate Governance-Praktiken und -verfahren für das Geschäftsjahr übereinstimmen. Die einzelnen, von der Gesellschaft engagierten Dienstleister unterliegen ihren eigenen Corporate Governance-Anforderungen.

*Finanzberichterstattung – Beschreibung der wichtigsten Merkmale*

Der Verwaltungsrat muss für die Finanzberichterstattung angemessene interne Systeme zur Kontrolle und Verwaltung des Risikos der Gesellschaft einführen und aufrechterhalten. Derartige Systeme haben nicht zum Ziel, das Risiko, dass die Gesellschaft ihre Ziele im Zusammenhang mit der Finanzberichterstattung nicht erreicht, völlig auszuschalten, sondern es zu verwalten. Sie bieten keine vollständige, jedoch eine angemessene Absicherung gegen falsche Darstellungen und Verluste.

Der Verwaltungsrat verfügt über bewährte Verfahren im Zusammenhang mit Systemen für interne Kontrolle und Risikomanagement, um die effiziente Überwachung des Finanzberichterstattungsverfahrens zu gewährleisten. Diese Verfahren umfassen die Ernennung des Administrators, Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited, der die Bücher und Aufzeichnungen führt. Der Administrator ist von der Central Bank of Ireland zugelassen und reguliert und muss sich an die von dieser erlassenen Regeln halten. Darüber hinaus ist der Administrator vertraglich verpflichtet, den Jahresbericht, einschließlich des Abschlusses, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Geschäftslage der Gesellschaft geben soll, sowie die Halbjahresabschlüsse zu erstellen, die durch den Verwaltungsrat überprüft und genehmigt werden.

Der Verwaltungsrat beurteilt und diskutiert bei Bedarf wesentliche Probleme im Zusammenhang mit Rechnungslegung und Berichterstattung. Darüber hinaus untersucht und beurteilt der Verwaltungsrat von Zeit zu Zeit die Finanzbuchhaltungs- und Berichterstattungsprozeduren des Administrators und überwacht und bewertet die Leistung, Qualifikation und Unabhängigkeit des externen Abschlussprüfers. Der Administrator hat die operative Verantwortung für seine internen Kontrollen im Zusammenhang mit dem Finanzberichterstattungsverfahren und dem Bericht des Administrators an den Verwaltungsrat.

*Risikobewertung*

Der Verwaltungsrat ist für die Beurteilung des Risikos von Regelwidrigkeiten verantwortlich, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Fehler in der Finanzberichterstattung zurückzuführen sind. Darüber hinaus muss er gewährleisten, dass entsprechende Verfahren zur rechtzeitigen Identifizierung interner und externer Angelegenheiten existieren, die sich möglicherweise auf die Finanzberichterstattung auswirken. Darüber hinaus hat der Verwaltungsrat Verfahren zur Identifizierung von Änderungen der Rechnungslegungsregeln und -empfehlungen eingeführt, und um zu gewährleisten, dass diesen Veränderungen in den Abschlüssen der Gesellschaft entsprechend Rechnung getragen wird.

*Kontrollaktivitäten*

Der Administrator verfügt über Kontrollstrukturen zur Verwaltung der mit der Finanzberichterstattung verbundenen Risiken. Diese Kontrollstrukturen umfassen die angemessene Teilung der Verantwortung und spezifischen Kontrollaktivitäten mit dem Ziel, für alle wichtigen Konten im Abschluss und in den entsprechenden Erläuterungen im Jahresbericht der Gesellschaft wesentliche Mängel in der Finanzberichterstattung aufzudecken oder solchen vorzubeugen. Beispiele für die durch den Administrator durchgeführten Kontrollen sind analytische Prüfungen, Abgleiche und automatische Kontrollen der IT-Systeme. Die Methode zur Bewertung von Wertpapieren und anderen Vermögenswerten, wenn keine Kurse aus externen, unabhängigen Quellen verfügbar sind, wird in Erläuterung 3(c) beschrieben.

*Information und Kommunikation*

Um zu gewährleisten, dass die Anforderungen an die Informationen über die Finanzberichterstattung vollständig und angemessen erfüllt werden, werden die Grundsätze der Gesellschaft und die Anweisungen des Verwaltungsrats, die Auswirkungen auf die Finanzberichterstattung haben, über geeignete Kanäle aktualisiert und mitgeteilt, z.B. über E-Mail, Schriftverkehr und Versammlungen.

*Überwachung*
Der Verwaltungsrat erhält regelmäßig Präsentationen und Kontrollberichte von der Depotbank, der Anlageberatungsgesellschaft und dem Administrator. Des Weiteren verfügt der Verwaltungsrat über ein jährliches Verfahren, um angemessene Reaktionen auf vom unabhängigen Abschlussprüfer identifizierte Mängel und empfohlene Maßnahmen zu gewährleisten.

*Kapitalstruktur*
Niemand hält eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung an der Gesellschaft. Niemand verfügt über besondere Kontrollrechte am Grundkapital der Gesellschaft.

Die Stimmrechte sind in keiner Weise eingeschränkt.

*Befugnisse des Verwaltungsrats*
Im Hinblick auf die Ernennung und Ersetzung von Verwaltungsratsmitgliedern unterliegt die Gesellschaft ihrer Satzung, den irischen Gesetzen einschließlich dem Companies Act von 2014 und den OGAW-Richtlinien und Notierungsregeln der Irish Stock Exchange für Investmentfonds. Die Satzung kann durch Sonderbeschlüsse der Anteilinhaber geändert werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, die Geschäfte der Gesellschaft in Übereinstimmung mit der Satzung zu führen. Der Verwaltungsrat kann bestimmte Aufgaben an den Administrator und andere Parteien übertragen, wobei diese der Überwachung und Leitung des Verwaltungsrats unterstehen. Der Verwaltungsrat hat den Administrator mit der täglichen Verwaltung der Gesellschaft beauftragt und hat die Anlageverwaltung und die Vertriebsfunktionen an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen. Kein Verwaltungsratsmitglied ist daher ein geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied.

Gemäß der Satzung darf der Verwaltungsrat die Befugnisse der Gesellschaft wahrnehmen, wie z.B. Kredite aufnehmen oder vergeben, das Unternehmen, dessen Eigentum oder einen Teil davon hypothekarisch oder anderweitig belasten, oder sie an die Anlageverwaltungsgesellschaft übertragen.

In den folgenden Situationen darf der Verwaltungsrat jederzeit und zu gegebener Zeit die Berechnung des Nettoinventarwerts eines bestimmten Teilfonds sowie die Ausgabe, die Rücknahme und den Umtausch von Anteilen vorübergehend aussetzen:

(a) während Zeiträumen (mit Ausnahme von gesetzlichen Feiertagen oder üblichen Schließungen an Wochenenden), in denen ein Markt oder eine anerkannte Börse geschlossen oder der Handel an ihm/ihr eingeschränkt ist, der/die den Hauptmarkt für einen wesentlichen Teil der Anlagen des betreffenden Teilfonds bildet;

(b) während Zeiträumen, in denen eine Notsituation vorliegt, die dazu führt, dass die Gesellschaft Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens einer bestimmten Klasse bilden, praktisch nicht veräußern kann, die Übertragung von Geldern für den Erwerb oder die Veräußerung von Anlagen zu normalen Wechselkursen nicht möglich ist oder der Verwaltungsrat oder dessen Bevollmächtigter praktisch nicht in der Lage ist, den Wert von Anlagen des betreffenden Teilfonds angemessen zu bestimmen;

(c) während eines Ausfalls der normalerweise zur Bestimmung des Preises irgendeiner Anlage des betreffenden Teilfonds oder der aktuellen Kurse an einem beliebigen Markt oder einer anerkannten Börse verwendeten Kommunikationsmittel;

(d) wenn aus irgendeinem Grund die Preise einer Anlage der betreffenden Klasse nicht angemessen, umgehend oder genau ermittelt werden können;

(e) während Zeiträumen, in denen die Überweisung von Geldern für die Zahlung einer der Anlagen der betreffenden Klasse nach Meinung des Verwaltungsrats nicht zu normalen Wechselkursen möglich ist;

(f) bei Abwicklung der Gesellschaft oder Beendigung eines Teilfonds; oder

(g) wenn die Bestimmung des Wertes eines wesentlichen Teils der Anlagen der Gesellschaft oder eines Teilfonds aus einem anderen Grund unmöglich oder undurchführbar ist.

Die Central Bank of Ireland und die Irish Stock Exchange müssen umgehend über eine derartige Aussetzung und über das Ende einer derartigen Aussetzung informiert werden. Darüber hinaus muss sie Anteilszeichnern und Anteilinhabern, die die Rücknahme ihrer Anteile beantragen, bei Antragstellung oder Registrierung des schriftlichen Antrags auf Rücknahme mitgeteilt werden. Soweit möglich werden alle angemessenen Schritte unternommen, um die Aussetzung so schnell wie möglich zu beenden.

Eingetragene Anteile können schriftlich übertragen werden. Der schriftlichen Übertragung muss eine Bescheinigung des Übertragungsempfängers beiliegen, dass er die Anteile nicht für eine oder zugunsten einer US-Person erwirbt. Im Falle des Todes eines Mitanteilinhabers sind die anderen Mitanteilinhaber die einzigen Personen, die laut Administrator Anspruch auf das Eigentum oder eine Beteiligung an den auf den Namen der Mitanteilinhaber eingetragenen Anteile haben. Der Verwaltungsrat kann die Eintragung einer Übertragung ablehnen, wenn er darüber informiert oder davon überzeugt ist, dass die Übertragung dazu führen würde, dass das wirtschaftliche Eigentum einer Person zufällt, die damit gegen die vom Verwaltungsrat auferlegten Einschränkungen für den Besitz verstößt oder rechtliche, aufsichtsrechtliche, geldliche, steuerliche oder wesentliche administrative Nachteile für den entsprechenden Teilfonds oder die Anteilinhaber allgemein zur Folge hätte.

*Versammlungen der Anteilinhaber*
Die Jahreshauptversammlung der Gesellschaft findet normalerweise im Mai, an einem vom Verwaltungsrat festgelegten Datum in Dublin statt. Die Einladung zur Jahreshauptversammlung, auf der jedes Jahr der geprüfte Jahresabschluss der Gesellschaft (und die Berichte des Verwaltungsrats und der Abschlussprüfer) vorgelegt wird, wird den Anteilinhabern mindestens 21 volle Tage vor dem Datum der Versammlung an ihre eingetragene Anschrift zugesandt. Der Verwaltungsrat kann zu gegebener Zeit gemäß irischem Recht andere Hauptversammlungen einberufen.

Jeder Anteil berechtigt seinen Inhaber, an den Hauptversammlungen der Gesellschaft und des Teilfonds, den die Anteile repräsentieren, teilzunehmen und auf diesen abzustimmen. Auf Versammlungen der Anteilinhaber kann die Abstimmung per Handzeichen erfolgen, es sei denn, ein Anteilinhaber mit Stimmrecht auf der Versammlung oder der Vorsitzende der Versammlung verlangt eine Abstimmung per Stimmzettel. Bei einer Abstimmung per Handzeichen verfügt jeder Anteilinhaber über eine Stimme. Bei Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Gesellschaft, die den Anteilinhabern zur Abstimmung per Stimmzettel vorgelegt werden, verleiht jeder Anteil seinem Inhaber eine Stimme.

Keine Anteilsklasse verleiht ihren Anteilinhabern Vorzugs- oder Vorrechte oder Rechte auf Beteiligung an den Gewinnen oder Dividenden einer anderen Anteilsklasse oder Stimmrechte im Zusammenhang mit Angelegenheiten, die sich ausschließlich auf eine andere Anteilsklasse beziehen.

Beschlüsse zur Änderung der mit einer Anteilsklasse verbundenen Rechte erfordern die Zustimmung von drei Vierteln der Inhaber der Anteile, die auf der Hauptversammlung der Anteilsklasse anwesend oder vertreten sind und an der Abstimmung teilnehmen. Die beschlussfähige Mehrheit für Hauptversammlungen von Anteilsklassen, auf denen über eine Änderung der mit der Klasse verbundenen Rechte entschieden wird, beträgt mindestens zwei Personen, deren Anteilsbesitz ein Drittel der Anteile ausmacht.

Alle Anteile mit Ausnahme der Zeichneranteile geben dem Anteilinhaber Anspruch auf eine anteilmäßige Beteiligung an den Dividenden und am Nettovermögen des Teilfonds, der die Anteile ausgegeben hat. Dies gilt nicht für Dividenden, die vor dem Erwerb der Anteile durch den Anteilinhaber festgesetzt wurden.

Managementanteile berechtigen ihre Inhaber zur Teilnahme an und Abstimmung auf allen Hauptversammlungen der Gesellschaft, verleihen jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung an den Dividenden oder am Nettovermögen der Gesellschaft.

*Zusammensetzung und Funktionsweise des Verwaltungsrats und seiner Ausschüsse*
Der Verwaltungsrat besteht derzeit aus fünf Mitgliedern, von denen keines geschäftsführende Aufgaben übernimmt und von denen zwei von der Anlageberatungsgesellschaft unabhängig sind, wie von den Notierungsregeln der Irish Stock Exchange für Investmentfonds gefordert. Die Verwaltungsratsmitglieder können durch einen ordentlichen Beschluss der Anteilinhaber gemäß den durch den Irish Companies Act von 2014 festgelegten Verfahren ihres Amtes enthoben werden. Der Verwaltungsrat tritt mindestens einmal pro Quartal zusammen. Der Verwaltungsrat verfügt über einen für die Abschlussprüfung zuständigen Prüfungsausschuss, der aus zwei unabhängigen Mitgliedern besteht und im Laufe des Berichtszeitraums viermal zusammengetreten ist.

## VERBUNDENE PARTEIEN

Mit der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen, dem Treuhänder und/oder verbundenen Gesellschaften bzw. Konzerngesellschaften dieser („verbundene Parteien“) vorgenommene Transaktionen werden so durchgeführt, als wären sie sie unter gewöhnlichen geschäftlichen Bedingungen ausgehandelt worden, und nur dann, wenn sie im besten Interesse der Anteilinhaber sind. Der Verwaltungsrat ist davon überzeugt, dass Vorkehrungen (durch schriftliche Verfahren nachgewiesen) getroffen wurden, um sicherzustellen, dass Transaktionen mit verbundenen Parteien wie oben beschrieben durchgeführt werden, und dass diese Vorkehrungen während des Berichtszeitraums eingehalten wurden.

## MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2015 setzte sich der Verwaltungsrat aus folgenden Mitgliedern zusammen:

William R. Benz – ernannt am 17. April 2009, (Vorsitzender seit dem 13. Mai 2014)
Ryan Blute – ernannt am 30. Mai 2014
Craig A. Dawson – ernannt am 6. Mai 2009
David M. Kennedy – ernannt am 16. April 1999
Michael J. Meagher – ernannt am 10. Dezember 1997

Die Satzung sieht keinen turnusmäßigen Rücktritt der Verwaltungsratsmitglieder vor.

## SEKRETÄR

Brown Brothers Harriman Fund Administration Services (Ireland) Limited war während des zum 31. Dezember 2015 endenden Geschäftsjahres Sekretär der Gesellschaft.

## BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES SEKRETÄRS AN ANTEILEN UND VERTRÄGEN

Zum 31. Dezember 2015 hielt David M. Kennedy 6.815,74 (31. Dezember 2014: 7.243,85) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2014: 16.786,79) Anteile des Global Multi-Asset Fund, beide Teilfonds der Gesellschaft.

Keines der Verwaltungsratsmitglieder verfügte über einen Dienstleistungsvertrag mit der Gesellschaft.

## RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT

Dillon Eustace war während des Berichtszeitraums Rechtsberater (für irisches Recht) der Gesellschaft.

## UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

Die unabhängigen Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, haben ihre Bereitschaft bestätigt, ihre Aufgabe weiterhin gemäß dem Companies Act von 2014 wahrzunehmen.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied: David M. Kennedy

Verwaltungsratsmitglied: William R. Benz

Datum: 26. April 2016

# Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers

## BERICHT DES UNABHÄNGIGEN ABSCHLUSSPRÜFERS AN DIE ANTEILINHABER DER PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

### Bericht über den Abschluss

**Stellungnahme**
Nach unserer Einschätzung:

- vermittelt der Abschluss von PIMCO Funds: Global Investors Series plc (der „Abschluss“) ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenswerte, der Verbindlichkeiten und der Finanzlage der Gesellschaft und der Teilfonds zum 31. Dezember 2015 sowie der Ergebnisse für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- wurde der Abschluss ordnungsgemäß im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Bilanzierungsrichtlinien erstellt; und
- wurde der Abschluss in Übereinstimmung mit den Vorschriften des Companies Acts von 2014 und den Richtlinien der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) ordnungsgemäß erstellt.

**Prüfungsgegenstand**
Der Abschluss umfasst:

- den Finanzstatus zum 31. Dezember 2015;
- die Betriebsergebnisrechnung für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- den Ausweis der Veränderungen im Nettovermögen für das an diesem Tag abgelaufene Geschäftsjahr;
- das Anlagen- und Vermögenswertportfolio jedes Teilfonds zum 31. Dezember 2015; and
- die Erläuterungen zum Abschluss für die Gesellschaft sowie für sämtliche Teilfonds, einschließlich einer Zusammenfassung der wichtigen Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden sowie sonstiger erläuternder Informationen.

Die bei der Erstellung des Abschlusses zugrunde gelegten Rechnungslegungsrichtlinien sind das irische Gesetz und die vom Financial Reporting Council ausgegebenen und vom Institute of Chartered Accounts in Ireland veröffentlichten Rechnungslegungsstandards (Generally Accepted Accounting Practice in Irland).

Bei der Anwendung des Bilanzierungsrahmens hat der Verwaltungsrat eine Reihe subjektiver Beurteilungen vorgenommen, beispielsweise in Bezug auf wesentliche Bilanzierungsannahmen. Diesen Schätzungen wurden Annahmen und zukünftige Ereignisse zugrunde gelegt.

### Punkte, zu denen wir laut Companies Act von 2014 berichten müssen

- Wir haben alle Informationen und Erklärungen erhalten, die wir für unsere Prüfung für notwendig halten.
- Unserer Auffassung nach waren die Geschäftsbücher der Gesellschaft ausreichend, um eine problemlose und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu ermöglichen.
- Der Abschluss stimmt mit den Geschäftsbüchern überein.
- Unserer Meinung nach stimmen die Informationen im Bericht des Verwaltungsrats mit dem Abschluss überein.
- Auf Basis der im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses durchgeführten Arbeit sind wir zu der Auffassung gelangt, dass die in der Stellungnahme zur Corporate Governance enthaltene Beschreibung der wichtigsten Merkmale der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme in Bezug auf das Verfahren für die Erstellung von Finanzberichten mit dem Abschluss übereinstimmt und gemäß Paragraph 1373(2)(c) des Companies Act von 2014 erstellt wurde.
- Auf der Grundlage unserer Kenntnis und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses erlangt haben, haben wir in der in der Stellungnahme zur Corporate Governance enthaltenen Beschreibung der wichtigsten Merkmale der internen Kontroll- und Risikomanagementsysteme in Bezug auf das Verfahren für die Erstellung von Finanzberichten keine wesentlichen Falschangaben identifiziert.
- Auf Basis der im Rahmen unserer Prüfung des Abschlusses durchgeführten Arbeit sind wir der Ansicht, dass die gemäß Paragraph 1373 (2)(a), (b), (e) und (f) erforderlichen Informationen in der Stellungnahme zur Corporate Governance enthalten sind.

### Punkte, zu denen wir aufgrund von Einschränkungen berichten müssen

**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.

### Verantwortung für den Abschluss und die Prüfung

**Aufgaben des Abschlussprüfers und des Verwaltungsrats**
Wie im Bericht des Verwaltungsrats auf Seite 802 genauer erläutert, ist der Verwaltungsrat für die Erstellung des Abschlusses und für die Sicherstellung, dass dieser den tatsächlichen Verhältnissen entspricht, verantwortlich.

Wir sind dafür verantwortlich, den Abschluss in Übereinstimmung mit irischem Recht und den International Standards on Auditing (GB und Irland) zu prüfen und eine Stellungnahme dazu abzugeben. Laut diesen Richtlinien sind wir zur Einhaltung der Ethical Standards for Auditors des Auditing Practices Board verpflichtet.

Dieser Bericht einschließlich des Testats wurde ausschließlich für die Anteilinhaber der Gesellschaft als Organ gemäß § 391 des Companies Act von 2014 und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit unserer Stellungnahme akzeptieren oder übernehmen wir keine Verantwortung für andere Zwecke oder gegenüber anderen Personen, die von diesem Bericht Kenntnis erhalten oder in deren Hände er gerät, es sei denn, dies wurde von uns vorab ausdrücklich schriftlich zugesichert.

**Umfang einer Abschlussprüfung**
Wir haben unsere Prüfung gemäß den International Standards on Auditing (Großbritannien und Irland) durchgeführt. Zu einer Prüfung gehört der Erhalt von Nachweisen über die Beträge und Offenlegungen im Abschluss, um uns angemessen davon zu überzeugen, dass der Abschluss frei von wesentlichen Falschaussagen aufgrund von Betrug oder Fehlern ist. Dazu gehört eine Begutachtung dessen,

- ob die Bilanzierungsgrundsätze den Verhältnissen der Gesellschaft entsprechen und ob sie konsequent angewendet und angemessen offen gelegt wurden;
- der Angemessenheit der maßgeblichen vom Verwaltungsrat vorgenommenen Schätzungen; und
- ob die Gesamtdarstellung des Abschlusses angemessen ist.

Wir konzentrieren unsere Arbeit vorwiegend auf diese Bereiche, indem wir die Beurteilungen des Verwaltungsrats mit verfügbaren Nachweisen vergleichen, eigene Urteile bilden und die Angaben im Abschluss beurteilen.

Wir prüfen und untersuchen Informationen anhand von Stichproben und anderen Prüfungsverfahren, soweit wir dies für erforderlich halten, um eine geeignete Grundlage für unsere Rückschlüsse zu schaffen. Unsere Prüfungsnachweise erhalten wir durch eine Prüfung der Effektivität von Kontrollen, Prüfungshandlungen oder eine Kombination aus beiden Ansätzen.

Darüber hinaus haben wir die finanziellen und nicht finanziellen Informationen im Jahresbericht gelesen, um wesentliche Abweichungen vom geprüften Abschluss festzustellen und um Informationen zu identifizieren, die anscheinend basierend auf dem Wissen, das wir uns im Laufe der Prüfung angeeignet haben, anscheinend in erheblichem Umfang inkonsistent sind oder erheblich von diesem Wissen abweichen. Sollten wir über offensichtliche wesentliche falsche Angaben oder Unstimmigkeiten Kenntnis erhalten, wägen wir die Auswirkungen auf unseren Bericht ab.

Andrew O’ Callaghan
für und im Namen von PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory Audit Firm
Dublin
Datum: 26. April 2016

# Bericht der Depotbank

Wir haben das Geschäftsgebaren der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“) für das zum 31. Dezember 2015 endende Geschäftsjahr in unserer Eigenschaft als Depotbank der Gesellschaft untersucht.

Dieser Bericht, einschließlich des Bestätigungsvermerks, wurde ausschließlich für die Anteilinhaber der Gesellschaft als Körperschaft im Einklang mit Teil 5 der Richtlinien der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren) von 2011 in ihrer jeweils geltenden Fassung („OGAW-Richtlinien“) und zu keinem anderen Zweck erstellt. Mit diesem Testat übernehmen und akzeptieren wir keinerlei Verantwortung zu anderen Zwecken oder gegenüber anderen Personen, die Kenntnis von diesem Bericht erhalten.

## VERANTWORTUNG DER DEPOTBANK

Unsere Pflichten und unsere Verantwortung sind in Teil 5 der OGAW-Richtlinien dargelegt. Eine dieser Pflichten ist die Untersuchung des Geschäftsgebarens der Gesellschaft für jeden Rechnungslegungszeitraum von einem Jahr und die Berichterstattung hierüber an die Anteilinhaber.

Aus unserem Bericht geht hervor, ob die Gesellschaft unserer Meinung nach während dieses Zeitraums in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung der Gesellschaft und den OGAW-Richtlinien verwaltet wurde. Die Gesellschaft ist dafür verantwortlich, diese Bestimmungen einzuhalten. Sollte die Gesellschaft nicht für eine derartige Übereinstimmung gesorgt haben, ist es unsere Pflicht als Depotbank, hierüber zu berichten und die von uns getroffenen Abhilfemaßnahmen aufzuführen.

## GRUNDLAGE DES TESTATS DER DEPOTBANK

Die Depotbank führt alle Prüfungen durch, die ihrer Meinung nach angemessen sind, um ihre in Teil 5 der OGAW-Richtlinien erwähnten Pflichten zu erfüllen und zu gewährleisten, dass die Gesellschaft unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet wurde: (i) unter Einhaltung der von ihren Gründungsunterlagen und den entsprechenden Vorschriften auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse und (ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Gründungsunterlagen der Gesellschaft und den entsprechenden Vorschriften.

## TESTAT

Unserer Meinung nach wurde die Gesellschaft während des Jahres unter allen wesentlichen Gesichtspunkten folgendermaßen verwaltet:

(i) unter Einhaltung der von ihrer Gründungsurkunde und Satzung, den OGAW-Richtlinien und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2015 (die „OGAW-Richtlinien der Zentralbank“) auferlegten Anlagegrenzen und Kreditaufnahmebefugnisse; und

(ii) ansonsten in Übereinstimmung mit den Bestimmungen der Gründungsurkunde und Satzung, den OGAW-Richtlinien und den OGAW-Richtlinien der Zentralbank.

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

Datum: 26. April 2016

## 1. HISTORISCHE ENTWICKLUNG DES NETTOINVENTARWERTS

Nachstehend sind die in diesem Geschäftsjahr höchsten und niedrigsten Nettoinventarwerte je Anteil für die nachfolgend aufgeführten Klassen aufgeführt:

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 6,66 | $ 4,73 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 8,79 | 6,56 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,16 | 7,76 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,29 | 8,05 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,04 | 8,43 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,13 | 7,52 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 8,47 | 5,53 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 8,40 | 7,76 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,32 | 9,56 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 4,69 | 3,31 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 6,20 | 4,63 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 6,46 | 5,47 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 6,55 | 5,68 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 7,80 | 5,95 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 7,16 | 5,32 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 5,99 | 3,96 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,78 | 3,95 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,27 | 7,31 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,31 | 9,65 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,55 | 17,35 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,40 | 17,22 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,00 | 16,47 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,32 | 15,24 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,46 | 14,56 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,05 | 13,07 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,17 | 8,76 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,82 | 9,43 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,54 | 10,92 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,14 | 10,70 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,04 | 11,95 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,36 | 12,42 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,52 | 12,32 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,61 | 11,89 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,31 | 11,47 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,38 | 11,12 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,10 | 12,72 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,01 | 8,53 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,07 | 10,52 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,06 | 10,48 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,36 | 14,41 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,16 | 14,12 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,69 | 13,46 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,22 | 12,32 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,46 | 11,75 |
| **Class M - Retail ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,14 | 10,20 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,36 | 10,55 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,52 | 10,48 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,72 | 10,17 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,48 | 9,81 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,05 | 9,90 |
| **Class M - Retail ausschüttend II** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,13 | 9,17 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,46 | 9,64 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,99 | 9,98 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **PIMCO Dividend and Income Builder Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 11,02 | $ 8,94 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,70 | 9,53 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,32 | 9,77 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,31 | 10,86 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,71 | 10,63 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,64 | 9,48 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,91 | 8,50 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,12 | 9,56 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,01 | 10,31 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,42 | 10,51 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,21 | 10,10 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,97 | 9,92 |
| **Emerging Local Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,10 | 9,68 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,66 | 11,54 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,96 | 12,39 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,82 | 12,60 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,89 | 12,32 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,39 | 11,22 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,53 | 8,05 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,20 | 7,76 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 8,84 | 6,84 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,19 | 8,49 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,57 | 9,51 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,07 | 10,09 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,33 | 9,91 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,15 | 10,00 |
| **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 37,24 | 33,50 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 38,06 | 33,64 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 38,22 | 33,81 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 34,57 | 32,18 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 32,43 | 30,13 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 31,69 | 27,20 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,46 | 21,12 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,81 | 17,45 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,90 | 23,23 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,65 | 21,10 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,44 | 10,06 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,15 | 10,55 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,83 | 11,22 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,99 | 11,26 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,60 | 10,66 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,70 | 10,36 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,61 | 8,58 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,97 | 7,27 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,90 | 10,26 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,81 | 9,88 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 39,81 | 35,93 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 40,49 | 35,87 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 40,29 | 35,67 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 36,18 | 33,60 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 33,82 | 31,25 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 32,80 | 28,01 |

# Referenzinformationen (Forts.)

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 28,05 | $ 21,94 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 26,25 | 17,80 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,25 | 23,48 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,82 | 21,18 |
| **Class M - Retail ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,27 | 9,05 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,84 | 9,41 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,51 | 10,00 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,73 | 10,11 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,36 | 9,57 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,09 | 9,89 |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,19 | 10,83 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,32 | 11,69 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,69 | 12,55 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,30 | 12,38 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,06 | 12,31 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,55 | 11,78 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,64 | 9,82 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,82 | 10,02 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,44 | 9,22 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,51 | 10,07 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,93 | 10,92 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,69 | 10,87 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,41 | 10,85 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,98 | 10,44 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,21 | 8,79 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,94 | 8,99 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,55 | 10,33 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,54 | 10,21 |
| **Euro Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | € 21,67 | € 20,34 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 20,77 | 18,69 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,04 | 18,10 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,24 | 16,16 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,33 | 15,62 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,37 | 14,98 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,09 | 13,23 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,87 | 13,39 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,59 | 13,98 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,69 | 14,24 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,84 | 11,08 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,36 | 10,32 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,61 | 10,06 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,78 | 9,21 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,45 | 9,02 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,63 | 8,94 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,04 | 8,02 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,40 | 8,21 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,50 | 8,98 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,89 | 9,39 |
| **Global Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 26,13 | $ 25,16 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,41 | 23,55 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,40 | 23,00 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 22,55 | 21,61 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,67 | 20,27 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 20,82 | 18,76 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Global Bond Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 18,80 | $ 15,63 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,88 | 15,19 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,38 | 16,46 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,86 | 16,06 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,13 | 12,58 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,82 | 12,07 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,67 | 11,90 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,90 | 11,48 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,54 | 11,00 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,35 | 10,38 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,44 | 8,87 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,42 | 8,69 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,23 | 9,78 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,23 | 9,84 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,82 | 26,81 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,00 | 24,85 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,61 | 24,20 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,52 | 22,46 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 22,52 | 20,92 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,46 | 19,22 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,26 | 15,91 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,08 | 15,43 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,52 | 16,53 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,87 | 16,00 |
| **PIMCO Global Dividend Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,31 | 9,04 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,74 | 9,47 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,74 | 9,87 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,47 | 10,82 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,85 | 10,52 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,54 | 9,32 |
| **Global High Yield Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,98 | 17,76 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,78 | 17,89 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,96 | 16,89 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,79 | 14,83 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,18 | 13,46 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,54 | 12,69 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,77 | 7,23 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,07 | 8,66 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,81 | 11,03 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,35 | 10,85 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,11 | 10,10 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,45 | 10,65 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,39 | 10,76 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,62 | 10,07 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,79 | 9,27 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,61 | 9,63 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,69 | 12,30 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,68 | 7,13 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,07 | 10,29 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,82 | 10,26 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,97 | 18,75 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,62 | 18,72 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,70 | 17,52 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,24 | 15,22 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,53 | 13,79 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Global High Yield Bond Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 14,80 | $ 12,85 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,83 | 8,95 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,59 | 8,68 |
| **Class H - Institutional - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,03 | 9,12 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,34 | 9,62 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,27 | 9,70 |
| **Class M - Retail ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,88 | 9,89 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,20 | 10,43 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,18 | 10,55 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,39 | 9,92 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,58 | 9,14 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,19 | 10,03 |
| **Class M - Retail ausschüttend II** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,85 | 8,85 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,24 | 9,47 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,01 | 10,00 |
| **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,08 | 15,47 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,69 | 14,64 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,28 | 14,26 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,03 | 13,21 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,42 | 12,74 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,10 | 11,77 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,83 | 9,54 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,94 | 9,59 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,75 | 12,96 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,59 | 12,91 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,71 | 12,71 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,93 | 12,27 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,69 | 11,93 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,73 | 11,76 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,04 | 11,73 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,35 | 9,85 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,93 | 17,32 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,45 | 16,18 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,80 | 15,72 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,33 | 14,38 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,57 | 13,77 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,15 | 12,63 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,69 | 10,18 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,12 | 9,93 |
| **Class M - Retail ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,39 | 9,81 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,24 | 9,77 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,35 | 9,58 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,19 | 10,01 |
| **Class M - Retail ausschüttend II** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,46 | 9,77 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,39 | 10,00 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,00 | 9,98 |
| **Global Real Return Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,28 | 16,15 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,85 | 15,42 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,31 | 15,26 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,38 | 15,50 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,57 | 13,86 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 14,57 | 13,34 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Global Real Return Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 13,53 | $ 11,44 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,07 | 10,89 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,47 | 11,40 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,99 | 11,26 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,54 | 12,58 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,20 | 12,13 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,63 | 12,00 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,01 | 12,32 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,43 | 11,25 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,87 | 10,99 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,19 | 9,54 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,05 | 9,10 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,59 | 9,74 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,32 | 9,74 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,45 | 17,34 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,94 | 16,31 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,21 | 16,10 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,13 | 16,16 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,23 | 14,36 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 15,06 | 13,72 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,89 | 11,67 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 13,24 | 11,08 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,60 | 11,48 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,01 | 11,23 |
| **Income Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,12 | 11,66 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,87 | 11,03 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,19 | 10,64 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,63 | 10,40 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,98 | 10,54 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,04 | 10,55 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,00 | 10,34 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,63 | 10,40 |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,32 | 12,15 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,28 | 12,13 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,34 | 11,95 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,01 | 11,73 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,88 | 11,61 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,97 | 11,39 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,43 | 10,37 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,70 | 10,03 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,46 | 10,22 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,16 | 10,92 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,16 | 11,05 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,30 | 10,91 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,09 | 10,86 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,08 | 10,78 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,22 | 10,73 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,79 | 9,99 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,62 | 9,75 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,46 | 9,98 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,18 | 9,82 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,33 | 11,19 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,26 | 11,06 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,19 | 10,86 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,83 | 10,53 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **Low Average Duration Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 10,63 | $ 10,42 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,67 | 10,06 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,19 | 10,01 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,27 | 10,34 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,94 | 10,20 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,24 | 10,07 |
| **Class E - ausschüttend II** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,81 | 9,69 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,77 | 10,20 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,24 | 10,07 |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,52 | 24,68 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,95 | 24,06 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,09 | 23,48 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,05 | 22,82 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,22 | 22,24 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,15 | 21,06 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,20 | 18,57 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,03 | 17,83 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,13 | 16,56 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,04 | 16,02 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,92 | 12,39 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,68 | 12,31 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,95 | 12,08 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,54 | 11,96 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,27 | 11,77 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 12,39 | 11,40 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,52 | 10,30 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,78 | 9,96 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,47 | 9,74 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,18 | 9,62 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,18 | 26,32 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 26,51 | 25,40 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 26,35 | 24,72 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,10 | 23,73 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,08 | 22,98 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 23,87 | 21,59 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,72 | 18,92 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 19,34 | 18,12 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,31 | 16,67 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,08 | 15,99 |
| **US High Yield Bond Fund** | | |
| **Class E - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 26,31 | 24,17 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 25,93 | 24,64 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 24,76 | 23,37 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 22,01 | 20,83 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,15 | 18,88 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 20,26 | 17,68 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,63 | 12,08 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,79 | 11,76 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,65 | 16,53 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,96 | 15,70 |
| **Class E - ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,90 | 9,73 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,16 | 10,37 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,12 | 10,50 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,43 | 9,97 |

| | Höchster Nettoinventarwert je Anteil | Niedrigster Nettoinventarwert je Anteil |
|---|---|---|
| **US High Yield Bond Fund (Forts.)** | | |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | $ 10,59 | $ 9,14 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,45 | 9,52 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 9,58 | 7,12 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,01 | 6,97 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,61 | 10,70 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,45 | 10,89 |
| **Class H - Institutional - thesaurierend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,96 | 25,80 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 27,42 | 26,09 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 26,06 | 24,50 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 22,92 | 21,60 |
| Im am 31. Dezember 2011 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 21,86 | 19,54 |
| Im am 31. Dezember 2010 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 20,83 | 18,08 |
| Im am 31. Dezember 2009 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 18,01 | 12,31 |
| Im am 31. Dezember 2008 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,99 | 11,95 |
| Im am 31. Dezember 2007 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 17,73 | 16,62 |
| Im am 31. Dezember 2006 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 16,97 | 15,54 |
| **Class M - Retail ausschüttend** | | |
| Im am 31. Dezember 2015 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,98 | 9,79 |
| Im am 31. Dezember 2014 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,23 | 10,44 |
| Im am 31. Dezember 2013 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 11,23 | 10,59 |
| Im am 31. Dezember 2012 abgeschlossenen Geschäftsjahr | 10,40 | 10,00 |

# Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

**Abkürzungen der Kontrahenten:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AZD** | Australia and New Zealand Banking Group | **GRE** | RBS Securities Inc. | **NOM** | Nomura Securities International Inc. |
| **BCY** | Barclays Capital Inc. | **GSC** | Goldman Sachs & Co. | **NXN** | Natixis New York |
| **BOA** | Bank of America N.A. | **GST** | Goldman Sachs International | **RBC** | Royal Bank of Canada |
| **BOM** | Bank of Montreal | **HUS** | HSBC Bank USA, N.A. | **RCE** | RBC Europe Limited |
| **BOS** | Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith | **IND** | Credit Agricole Corp. & Inv. Calyon | **RDR** | RBC Capital Markets LLC |
| **BPG** | BNP Paribas Securities Corp. | **JML** | JP Morgan Securities Plc | **RYL** | Royal Bank of Scotland PLC |
| **BPS** | BNP Paribas S.A. | **JPM** | JPMorgan Chase Bank, N.A. | **SAL** | Citigroup Global Markets, Inc. |
| **BRC** | Barclays Bank PLC | **JPS** | JPMorgan Securities LLC | **SBI** | Citigroup Global Markets Limited |
| **BSN** | Bank of Nova Scotia - Toronto | **MBC** | HSBC Bank Plc | **SCX** | Standard Chartered Bank, London |
| **CBK** | Citibank N.A. | **MEI** | Merrill Lynch International | **SGY** | Societe Generale, New York |
| **CFR** | Credit Suisse Securities (Europe) Ltd. | **MSB** | Morgan Stanley Bank, N.A. | **SOG** | Societe Generale Paris |
| **CLY** | Credit Agricole Corp. & Inv. Calyon | **MSC** | Morgan Stanley & Co. LLC | **TDM** | TD Securities (USA) LLC |
| **DBL** | Deutsche Bank AG London | **MSX** | Morgan Stanley Capital Group, Inc. | **TOR** | The Toronto-Dominion Bank |
| **DEU** | Deutsche Bank Securities Inc. | **MYC** | Morgan Stanley Capital Services LLC | **UAG** | UBS AG Stamford |
| **DUB** | Deutsche Bank AG | **MYI** | Morgan Stanley & Co. International PLC | **ULO** | UBS AG London |
| **FBF** | Credit Suisse International | **NAB** | National Australia Bank Ltd. | | |
| **GLM** | Goldman Sachs Bank USA | **NGF** | Nomura Global Financial Products, Inc. | | |

**Währungskürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AED** | Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate | **HKD** | Hongkong-Dollar | **PHP** | Philippinischer Peso |
| **ARS** | Argentinischer Peso | **HUF** | Ungarischer Forint | **PLN** | Polnischer Zloty |
| **AUD** | Australischer Dollar | **IDR** | Indonesische Rupie | **QAR** | Qatari Riyal |
| **BRL** | Brasilianischer Real | **ILS** | Israelischer Shekel | **RON** | Rumänischer Leu |
| **CAD** | Kanadischer Dollar | **INR** | Indische Rupie | **RUB** | Russischer Rubel |
| **CHF** | Schweizer Franken | **ITL** | Italienische Lira | **SEK** | Schwedische Krone |
| **CLP** | Chilenischer Peso | **JPY** | Japanischer Yen | **SGD** | Singapur-Dollar |
| **CNH** | Chinese Renminbi (Offshore) | **KRW** | Südkoreanischer Won | **THB** | Thailändischer Baht |
| **CNY** | Chinese Renminbi (Mainland) | **MXN** | Mexikanischer Peso | **TRY** | Türkische Lira |
| **COP** | Kolumbianischer Peso | **MYR** | Malaysischer Ringgit | **TWD** | Taiwanesischer Dollar |
| **CZK** | Tschechische Krone | **NGN** | Nigerianische Naira | **USD($)** | US-Dollar |
| **DKK** | Dänische Krone | **NOK** | Norwegische Krone | **UYU** | Uruguayischer Peso |
| **EUR(€)** | Euro | **NZD** | Neuseeländischer Dollar | **ZAR** | Südafrikanischer Rand |
| **GBP(£)** | Britisches Pfund Sterling | **PEN** | Peruanischer Nuevo Sol | | |

**Index-Kürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **ABX.HE** | Asset-Backed Securities Index - Home Equity | **CDX.IG** | Credit Derivatives Index - Investment Grade | **HICP** | Harmonized Index of Consumer Prices |
| **CDX** | Credit Derivatives Index | **CMBX** | Commercial Mortgage-Backed Securities Index | **IBMEXID** | Mexico Interbank TIIE Banxico |
| **CDX.EM** | Credit Derivatives Index - Emerging Markets | **CPI** | Consumer Price Index | **MCDX** | Municipal Bond Credit Derivative Index |
| **CDX.HY** | Credit Derivatives Index - High Yield | **CPURNSA** | Nicht saisonbereinigter Verbraucherpreisindex-Urban Index | | |

**Kommunal- oder Behördenkürzel:**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **FSA** | Financial Security Assurance, Inc. | **FHLMC** | Federal Home Loan Mortgage Corp. |

**Sonstige Kürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **ABS** | Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier) | **KLIBOR** | Kuala Lumpur Interbank Offered Rate | **REIT** | Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) |
| **BRL-CDI** | Brazil Interbank Deposit Rate | **LIBOR** | London Interbank Offered Rate | **REMIC** | Real Estate Mortgage Investment Conduit |
| **EURIBOR** | Euro Interbank Offered Rate | **MBS** | Mortgage-Backed Security (hypothekenbesichertes Wertpapier) | **RMBS** | Residential Mortgage-Backed Security |
| **FEDL01** | Federal Funds Effective Rate | **MSCI** | Morgan Stanley Capital International | **SAJIBOR** | South African Johannesburg Interbank Offered Rate |
| **ISDA** | International Swaps and Derivatives Association, Inc. | **OJSC** | Open Joint Stock Company | **WIBOR** | Warsaw Interbank Offered Rate |

# Allgemeine Informationen

**VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**
PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd.,
30 Herbert Street,
Dublin 2,
Irland.

**ANLAGEBERATUNGSGESELLSCHAFT**
Pacific Investment Management Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, California 92660,
USA.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
501 Orchard Road, #09-03,
Wheelock Place,
Singapur 238880.

PIMCO Deutschland GmbH,
Seidlstraße 24-24a,
80335 München
Deutschland.

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

**DEPOTBANK**
Brown Brothers Harriman Trustee Services (Ireland) Limited,
30 Herbert Street,
Dublin 2,
Irland.

**VERTRIEBSSTELLEN**
PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
501 Orchard Road, #09-03,
Wheelock Place,
Singapur 238880.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australien.

**ÖSTERREICHISCHE ZAHLSTELLE**
UniCredit Bank Austria AG,
AMG/9991,
Am Hof 2,
1010 Wien, Österreich.

**REPRÄSENTANT IN SINGAPUR**
PIMCO Asia Pte Ltd.,
501 Orchard Road, #09-03,
Wheelock Place,
Singapur 238880.

**ITALIENISCHE KORRESPONDENZBANK**
State Street Bank SpA,
Via Ferrante Aporti, 10,
20125 Mailand,
Italien.

Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.
Piazzale Lodi, 3
20137 Mailand,
Italien.

BNP Paribas Securities Services,
Via Ansperto 5,
20123 Mailand,
Italien.

Société Générale Securities Services S.p.A. („SGSS“)
Via Benigno Crespi, 19/A - MAC 2,
20159 Mailand,
Italien.

Allfunds Bank S.A.,
Via Santa Margherita 7,
20121 Mailand,
Italien.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italien.

Banca Monte dei Paschi di Siena,
Piazza Salimbeni 3,
53100 Siena,
Italien.

**REPRÄSENTANT IN HONGKONG**
PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Unit 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hongkong.

**LUXEMBURGER ZAHLSTELLE UND VERTRETUNGSSTELLE**
BNP Paribas Securities Services,
23, avenue de la Porte-Neuve,
L-2085, Luxemburg.

**SCHWEIZER ZAHLSTELLE UND REPRÄSENTANZ**
BNP Paribas Securities Services,
Zweigstelle Zürich, Selnaustrasse 16,
8002 Zürich,
Schweiz.

**BRITISCHER REPRÄSENTANT**
PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
London W1U 3AH,
England.

**BELGISCHE ZAHLSTELLE**
Société Générale Private Banking NV,
Kortrijksesteenweg 302,
B-9000 Gent,
Belgien.

**DEUTSCHE ZAHL- UND INFORMATIONSSTELLE**
Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hamburg,
Deutschland.

**PORTUGIESISCHE ZAHLSTELLE**
Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lissabon,
Portugal.

**SCHWEDISCHE ZAHLSTELLE**
SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Schweden.

**GRIECHISCHE ZAHLSTELLE**
Eurobank Ergasias S.A.,
22, Voukourestriou & 3, Valaoritou str.
GR 10671 Athen,
Griechenland.

**RECHTSBERATER FÜR IRISCHES RECHT**
Dillon Eustace,
33 Sir John Rogerson’s Quay,
Dublin 2,
Irland.

**RECHTSBERATER FÜR US-RECHT**
Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
USA.

**UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER**
PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants und Statutory Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
Irland.

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

**BETREUENDER MAKLER**
Dillon Eustace,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
Irland.

**EINGETRAGENER GESCHÄFTSSITZ**
PIMCO Funds: Global Investors Series plc,
30 Herbert Street,
Dublin 2,
Irland.

**VERWALTUNGSRAT DER GESELLSCHAFT UND VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**
William R. Benz[1]
Craig A. Dawson[1]
Ryan Blute[1]
David M. Kennedy (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)
Michael J. Meagher (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied)

**FRANZÖSISCHE ZENTRALISIERUNGS- UND FINANZSTELLE**
Société Générale Securities Services,
3, Rue d'Antin,
75002 Paris,
Frankreich.

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Büro des Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 31. Dezember 2015 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anlegern kostenlos bei der Depotbank oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

[1] Mitarbeiter von PIMCO.