

UniInstitutional Global High Yield Bonds

WKN A0EQ9M
ISIN LU0220302995

Halbjahresbericht
01.10.2019 - 31.03.2020

Wertentwicklung in Prozent ¹⁾

| | 6 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 10 Jahre |
|--|----------|--------|---------|----------|
| | -17,56 | -15,41 | -12,74 | 33,46 |

1) Auf Basis veröffentlichter Anteilwerte (BVI-Methode).

Geografische Länderaufteilung ¹⁾

| | |
|---|-----------------|
| Deutschland | 18,18 % |
| Niederlande | 15,44 % |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 15,31 % |
| Frankreich | 11,26 % |
| Großbritannien | 5,08 % |
| Luxemburg | 3,67 % |
| Italien | 2,34 % |
| Österreich | 2,11 % |
| Schweden | 2,11 % |
| Spanien | 2,09 % |
| Irland | 1,45 % |
| Rumänien | 1,23 % |
| Dänemark | 0,68 % |
| Cayman Inseln | 0,52 % |
| Norwegen | 0,47 % |
| Belgien | 0,36 % |
| Kanada | 0,25 % |
| Jersey | 0,23 % |
| Finnland | 0,10 % |
| Wertpapiervermögen | 82,88 % |
| Optionen | -0,98 % |
| Terminkontrakte | 0,00 % |
| Credit Default Swaps | -2,58 % |
| Bankguthaben | 8,33 % |
| Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten | 12,35 % |
| Fondsvermögen | 100,00 % |

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

Wirtschaftliche Aufteilung ¹⁾

| | |
|---|-----------------|
| Roh-, Hilfs- & Betriebsstoffe | 22,48 % |
| Automobile & Komponenten | 12,94 % |
| Groß- und Einzelhandel | 7,21 % |
| Investitionsgüter | 5,53 % |
| Verbraucherdienste | 5,53 % |
| Immobilien | 4,81 % |
| Media & Entertainment | 3,89 % |
| Pharmazeutika, Biotechnologie & Biowissenschaften | 3,73 % |
| Gesundheitswesen: Ausstattung & Dienste | 2,82 % |
| Lebensmittel, Getränke & Tabak | 2,77 % |
| Gewerbliche Dienste & Betriebsstoffe | 2,55 % |
| Hardware & Ausrüstung | 2,36 % |
| Energie | 1,93 % |
| Staatsanleihen | 1,12 % |
| Versorgungsbetriebe | 0,87 % |
| Haushaltsartikel & Körperpflegeprodukte | 0,74 % |
| Gebrauchsgüter & Bekleidung | 0,57 % |
| Transportwesen | 0,57 % |
| Software & Dienste | 0,46 % |
| Wertpapiervermögen | 82,88 % |
| Optionen | -0,98 % |
| Terminkontrakte | 0,00 % |
| Credit Default Swaps | -2,58 % |
| Bankguthaben | 8,33 % |
| Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten | 12,35 % |
| Fondsvermögen | 100,00 % |

1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.

UniInstitutional Global High Yield Bonds

Zusammensetzung des Fondsvermögens zum 31. März 2020

| | EUR |
|---|-----------------------|
| Wertpapiervermögen (Wertpapiereinstandskosten: EUR 269.172.501,72) | 230.707.953,36 |
| Bankguthaben | 23.177.329,82 |
| Sonstige Bankguthaben | 47.635.897,73 |
| Nicht realisierte Gewinne aus Terminkontrakten | 7.200,00 |
| Zinsforderungen aus Wertpapieren | 3.047.092,61 |
| Forderungen aus Wertpapiergeschäften | 997.606,58 |
| Forderungen aus Devisenwechsellkursgeschäften | 2.187.585,45 |
| Sonstige Forderungen | 21.413,00 |
| | 307.782.078,55 |
| Optionen | -2.729.480,00 |
| Nicht realisierte Verluste aus Devisentermingeschäften | -413.993,31 |
| Nicht realisierte Verluste aus Credit Default Swaps | -7.111.345,70 |
| Zinsverbindlichkeiten | -11.454,55 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften | -15.534.175,00 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenwechsellkursgeschäften | -2.188.084,06 |
| Sonstige Passiva | -1.473.992,22 |
| | -29.462.524,84 |
| Fondsvermögen | 278.319.553,71 |
| Umlaufende Anteile | 7.929.061,000 |
| Anteilwert | 35,10 EUR |

Veränderung des Fondsvermögens

im Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2019 bis zum 31. März 2020

| | EUR |
|--|-----------------------|
| Fondsvermögen zu Beginn des Berichtszeitraumes | 352.258.329,78 |
| Ordentlicher Nettoertrag | 4.445.224,57 |
| Ertrags- und Aufwandsausgleich | 81.061,87 |
| Mittelzuflüsse aus Anteilverkäufen | 51.221.848,63 |
| Mittelabflüsse aus Anteilrücknahmen | -51.993.553,71 |
| Realisierte Gewinne | 153.643.730,65 |
| Realisierte Verluste | -170.390.318,02 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Gewinne | -21.782.833,93 |
| Nettoveränderung nicht realisierter Verluste | -29.088.412,29 |
| Ausschüttung | -10.075.523,84 |
| Fondsvermögen zum Ende des Berichtszeitraumes | 278.319.553,71 |

Aufwands- und Ertragsrechnung

im Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2019 bis zum 31. März 2020

| | EUR |
|--|----------------------|
| Erträge aus Investmentanteilen | 7.208,00 |
| Zinsen auf Anleihen | 5.357.231,58 |
| Bankzinsen | -22.763,78 |
| Erträge aus Wertpapierleihe | 83.939,77 |
| Erträge aus Wertpapierleihe Kompensationszahlungen | 344.287,50 |
| Erträge aus Swing Pricing | 251.422,03 |
| Sonstige Erträge | 18.928,79 |
| Ertragsausgleich | -108.494,04 |
| Erträge insgesamt | 5.931.759,85 |
| Zinsaufwendungen | -102.942,79 |
| Verwaltungsvergütung | -1.033.490,11 |
| Pauschalgebühr | -171.913,98 |
| Druck und Versand der Jahres- und Halbjahresberichte | -1.898,03 |
| Veröffentlichungskosten | -456,17 |
| Taxe d'abonnement | -78.389,69 |
| Sonstige Aufwendungen | -124.876,68 |
| Aufwandsausgleich | 27.432,17 |
| Aufwendungen insgesamt | -1.486.535,28 |
| Ordentlicher Nettoertrag | 4.445.224,57 |

1) Siehe Erläuterungen zum Bericht.

Entwicklung der Anzahl der Anteile im Umlauf

| | Stück |
|---|----------------------|
| Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraumes | 8.033.490,000 |
| Ausgegebene Anteile | 1.212.877,000 |
| Zurückgenommene Anteile | -1.317.306,000 |
| Umlaufende Anteile zum Ende des Berichtszeitraumes | 7.929.061,000 |

UnInstitutional Global High Yield Bonds

Vermögensaufstellung zum 31. März 2020

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾ |
|-------------------------------------|--|-----------|-----------|-----------|----------|----------------------|---|
| | | | | | | EUR | |
| Anleihen | | | | | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| BE6320934266 | 2,125 % Anheuser-Busch InBev S.A./NV EMTN Reg.S. v.20(2027) | 200.000 | 0 | 200.000 | 100,0930 | 200.186,00 | 0,07 |
| BE6320935271 | 2,875 % Anheuser-Busch InBev S.A./NV EMTN Reg.S. v.20(2032) | 500.000 | 0 | 500.000 | 98,5680 | 492.840,00 | 0,18 |
| BE6320936287 | 3,700 % Anheuser-Busch InBev S.A./NV Reg.S. v.20(2040) | 300.000 | 0 | 300.000 | 100,3600 | 301.080,00 | 0,11 |
| XS2085860844 | 5,000 % Asseblin Finacing AB (Publ) Reg.S. FRN v.19(2025) | 800.000 | 0 | 800.000 | 88,0000 | 704.000,00 | 0,25 |
| XS1645722262 | 1,875 % Atlantia S.p.A. EMTN Reg.S. v.17(2027) | 2.000.000 | 0 | 2.000.000 | 79,5000 | 1.590.000,00 | 0,57 |
| XS2112340679 | 3,500 % Banijay Entertainment S.A.S. Reg.S. v.20(2025) | 600.000 | 0 | 600.000 | 90,1080 | 540.648,00 | 0,19 |
| XS1265778933 | 3,125 % Cellnex Telecom S.A. EMTN Reg.S. v.15(2022) | 0 | 1.000.000 | 2.700.000 | 102,4130 | 2.765.151,00 | 0,99 |
| XS2102934697 | 1,000 % Cellnex Telecom S.A. Reg.S. v.20(2027) | 900.000 | 0 | 900.000 | 85,2350 | 767.115,00 | 0,28 |
| XS1801786275 | 4,000 % Coty Inc. Reg.S. v.18(2023) | 0 | 0 | 1.000.000 | 83,1450 | 831.450,00 | 0,30 |
| XS1878856803 | 3,000 % Dometic Group AB EMTN Reg.S. v.18(2023) | 500.000 | 0 | 500.000 | 86,9640 | 434.820,00 | 0,16 |
| XS1991114858 | 3,000 % Dometic Group AB EMTN Reg.S. v.19(2026) | 3.000.000 | 1.000.000 | 5.900.000 | 78,0000 | 4.602.000,00 | 1,65 |
| XS2079388828 | 2,000 % Dufry One BV Reg.S. v.19(2027) | 4.800.000 | 3.500.000 | 1.300.000 | 77,7180 | 1.010.334,00 | 0,36 |
| XS2074522975 | 2,625 % eircom Finance DAC Reg.S. v.19(2027) | 1.300.000 | 0 | 1.300.000 | 88,0410 | 1.144.533,00 | 0,41 |
| XS1232188257 | 1,114 % FCE Bank Plc. EMTN Reg.S. v.15(2020) | 0 | 0 | 1.000.000 | 98,6000 | 986.000,00 | 0,35 |
| XS2013574384 | 2,386 % Ford Motor Credit Co. LLC v.19(2026) | 1.000.000 | 2.200.000 | 1.000.000 | 73,2500 | 732.500,00 | 0,26 |
| XS1910293643 | 6,250 % Groupe Ecore Holding S.A.S. EO-FLR Notes 2018(20/23) Reg.S | 0 | 725.000 | 275.000 | 70,5590 | 194.037,25 | 0,07 |
| XS2147977479 | 1,625 % Heineken NV EMTN Reg.S. v.20(2025) | 400.000 | 0 | 400.000 | 102,1300 | 408.520,00 | 0,15 |
| XS2147977636 | 2,250 % Heineken NV EMTN Reg.S. v.20(2030) | 400.000 | 0 | 400.000 | 105,0890 | 420.356,00 | 0,15 |
| XS1647643110 | 6,250 % HEMA Bondco I BV Reg.S. FRN v.17(2022) | 0 | 0 | 1.000.000 | 40,4700 | 404.700,00 | 0,15 |
| DE000A255DH9 | 3,250 % HORNBAACH Baumarkt AG Reg.S. v.19(2026) | 9.600.000 | 7.000.000 | 2.600.000 | 95,0000 | 2.470.000,00 | 0,89 |
| XS1854830889 | 3,250 % K+S Aktiengesellschaft Reg.S. v.18(2024) ²⁾ | 3.500.000 | 6.000.000 | 1.500.000 | 69,0000 | 1.035.000,00 | 0,37 |
| XS1799641045 | 4,125 % LKQ European Holdings BV Reg.S. v.18(2028) | 0 | 0 | 300.000 | 87,0000 | 261.000,00 | 0,09 |
| XS1960685383 | 2,000 % Nokia Oyj EMTN Reg.S. v.19(2026) | 0 | 4.000.000 | 300.000 | 89,7540 | 269.262,00 | 0,10 |
| XS1713465687 | 5,000 % OCI NV Reg.S. v.18(2023) | 0 | 0 | 450.000 | 93,8620 | 422.379,00 | 0,15 |
| XS1405765907 | 3,125 % Oi European Group BV Reg.S. v.16(2024) | 1.000.000 | 0 | 2.000.000 | 94,8460 | 1.896.920,00 | 0,68 |
| DE000A2G8WA3 | 3,000 % Progroup AG Reg.S. v.18(2026) ²⁾ | 0 | 6.168.000 | 1.432.000 | 83,5000 | 1.195.720,00 | 0,43 |
| XS2107451069 | 2,500 % RCS & RDS S.A. Reg.S. v.20(2025) | 2.000.000 | 0 | 2.000.000 | 90,2690 | 1.805.380,00 | 0,65 |
| XS2107452620 | 3,250 % RCS & RDS S.A. Reg.S. v.20(2028) | 1.900.000 | 0 | 1.900.000 | 85,0000 | 1.615.000,00 | 0,58 |
| XS1811792792 | 3,500 % Samsonite Finco S.à r.l. Reg.S. v.18(2026) ²⁾ | 1.000.000 | 0 | 1.400.000 | 65,9090 | 922.726,00 | 0,33 |
| FR0013505104 | 1,000 % Sanofi S.A. EMTN Reg.S. v.20(2025) | 300.000 | 0 | 300.000 | 102,3140 | 306.942,00 | 0,11 |
| FR0013505112 | 1,500 % Sanofi S.A. EMTN Reg.S. v.20(2030) | 200.000 | 0 | 200.000 | 106,5140 | 213.028,00 | 0,08 |
| XS0600056641 | 4,750 % Ses S.A. EMTN Reg.S. v.11(2021) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 102,3520 | 1.023.520,00 | 0,37 |
| XS2067263850 | 5,750 % Summer [BC] Holdco B S.a.r.l. Reg.S. v.19(2026) | 700.000 | 200.000 | 500.000 | 83,6590 | 418.295,00 | 0,15 |
| XS2122933695 | 1,875 % The Dow Chemical Co. v.20(2040) | 400.000 | 0 | 400.000 | 79,4840 | 317.936,00 | 0,11 |
| DE000A14J579 | 1,750 % thyssenkrupp AG EMTN Reg.S. v.15(2020) | 4.000.000 | 0 | 5.000.000 | 97,7110 | 4.885.550,00 | 1,76 |
| DE000A2TEDB8 | 2,875 % thyssenkrupp AG EMTN Reg.S. v.19(2024) | 2.300.000 | 1.000.000 | 1.300.000 | 87,5000 | 1.137.500,00 | 0,41 |
| DE000A2BPET2 | 1,375 % thyssenkrupp AG Reg.S. v.17(2022) | 600.000 | 0 | 600.000 | 91,7500 | 550.500,00 | 0,20 |
| XS2010040124 | 1,250 % ZF Europe Finance BV v.19(2023) | 700.000 | 0 | 700.000 | 84,4110 | 590.877,00 | 0,21 |
| | | | | | | 39.867.805,25 | 14,32 |
| USD | | | | | | | |
| US034863AM25 | 4,125 % Anglo American Capital Plc. 144A v.14(2021) | 2.000.000 | 0 | 2.000.000 | 100,3755 | 1.829.833,20 | 0,66 |
| US03523TBB35 | 4,375 % Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. v.11(2021) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 101,7160 | 927.135,17 | 0,33 |
| US05526DBN49 | 4,906 % B.A.T. Capital Corporation v.20(2030) | 500.000 | 0 | 500.000 | 102,0910 | 465.276,64 | 0,17 |
| USU31436AG04 | 4,250 % Fresenius US Finance II Inc. Reg.S. v.14(2021) | 0 | 0 | 2.000.000 | 102,3750 | 1.866.283,84 | 0,67 |
| US532716AK37 | 6,950 % L Brands Inc. v.03(2033) | 0 | 0 | 1.200.000 | 62,3725 | 682.225,87 | 0,25 |
| US532716AT46 | 6,625 % L Brands Inc. v.11(2021) | 2.000.000 | 0 | 2.000.000 | 95,2760 | 1.736.869,93 | 0,62 |
| US68389XBU81 | 2,800 % Oracle Corporation v.20(2027) | 400.000 | 0 | 400.000 | 100,7550 | 367.350,29 | 0,13 |
| US68389XBV64 | 2,950 % Oracle Corporation v.20(2030) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 100,9240 | 919.916,14 | 0,33 |
| US382550BA86 | 8,750 % The Goodyear Tire & Rubber Co. v.10(2020) | 2.750.000 | 0 | 2.750.000 | 99,9505 | 2.505.367,56 | 0,90 |
| | | | | | | 11.300.258,64 | 4,06 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | 51.168.063,89 | 18,38 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UnInstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾ |
|------|-------------|---------|---------|---------|------|----------|---|
| | | | | | | EUR | |

Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind

EUR

| | | | | | | | |
|--------------|--|-----------|---|-----------|----------|----------------------|-------------|
| FR0013505625 | 2,125 % Aéroports de Paris S.A. Reg.S. v.20(2026) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 99,8410 | 998.410,00 | 0,36 |
| FR0013505633 | 2,750 % Aéroports de Paris S.A. Reg.S. v.20(2030) | 700.000 | 0 | 700.000 | 100,8830 | 706.181,00 | 0,25 |
| FR0013505559 | 1,000 % Air Liquide Finance EMTN Reg.S. v.20(2025) | 300.000 | 0 | 300.000 | 102,1480 | 306.444,00 | 0,11 |
| FR0013505567 | 1,375 % Air Liquide Finance EMTN Reg.S. v.20(2030) | 200.000 | 0 | 200.000 | 104,5490 | 209.098,00 | 0,08 |
| XS2112335752 | 6,500 % Banijay Entertainment S.A.S. Reg.S. v.20(2026) | 500.000 | 0 | 500.000 | 78,9070 | 394.535,00 | 0,14 |
| XS2093880735 | 1,000 % Berry Global Inc. Reg.S. v.20(2025) | 3.200.000 | 0 | 3.200.000 | 90,8750 | 2.908.000,00 | 1,04 |
| XS2093881030 | 1,500 % Berry Global Inc. Reg.S. v.20(2027) | 700.000 | 0 | 700.000 | 90,0000 | 630.000,00 | 0,23 |
| XS2149280948 | 2,000 % Bertelsmann SE & Co. KGaA EMTN Reg.S. v.20(2028) | 900.000 | 0 | 900.000 | 101,7780 | 916.002,00 | 0,33 |
| FR0013505260 | 2,625 % Carrefour S.A. EMTN Reg.S. v.20(2027) | 700.000 | 0 | 700.000 | 103,1750 | 722.225,00 | 0,26 |
| XS2150053721 | 1,750 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. EMTN Reg.S. v.20(2023) | 700.000 | 0 | 700.000 | 99,8490 | 698.943,00 | 0,25 |
| XS2150054372 | 2,375 % Compagnie de Saint-Gobain S.A. Reg.S. v.20(2027) | 700.000 | 0 | 700.000 | 98,8130 | 691.691,00 | 0,25 |
| XS2116728895 | 1,744 % Ford Motor Credit Co. LLC EMTN v.20(2024) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 78,3750 | 783.750,00 | 0,28 |
| XS2150006133 | 1,375 % John Deere Cash Management S.a.r.l. EMTN Reg.S. v.20(2024) | 900.000 | 0 | 900.000 | 100,0240 | 900.216,00 | 0,32 |
| XS2150006562 | 2,200 % John Deere Cash Management S.a.r.l. EMTN Reg.S. v.20(2022) | 700.000 | 0 | 700.000 | 100,6280 | 704.396,00 | 0,25 |
| XS2150006307 | 1,850 % John Deere Cash Management S.a.r.l. Reg.S. v.20(2028) | 600.000 | 0 | 600.000 | 99,6850 | 598.110,00 | 0,21 |
| XS2150015555 | 1,750 % Koninklijke Ahold Delhaize NV Reg.S. v.20(2027) | 400.000 | 0 | 400.000 | 101,5380 | 406.152,00 | 0,15 |
| XS2148390755 | 1,500 % Nestlé Finance International Ltd. EMTN Reg.S. v.20(2030) | 300.000 | 0 | 300.000 | 105,9030 | 317.709,00 | 0,11 |
| XS2148372696 | 1,125 % Nestlé Finance International Ltd. Reg.S. v.20(2026) | 300.000 | 0 | 300.000 | 103,1940 | 309.582,00 | 0,11 |
| DE000NRWOL93 | 0,000 % Nordrhein-Westfalen Reg.S. v.20(2024) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 100,2850 | 1.002.850,00 | 0,36 |
| AT0000A2EJZ6 | 0,000 % Österreich Reg.S. v.20(2023) | 2.100.000 | 0 | 2.100.000 | 101,3710 | 2.128.791,00 | 0,76 |
| FR0013505542 | 1,250 % Suez S.A. EMTN Reg.S. v.20(2027) | 600.000 | 0 | 600.000 | 100,7490 | 604.494,00 | 0,22 |
| | | | | | | 16.937.579,00 | 6,07 |
| | | | | | | 16.937.579,00 | 6,07 |

Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

EUR

| | | | | | | | |
|--------------|--|------------|-----------|-----------|----------|--------------|------|
| XS1468662801 | 3,500 % Adient Global Holdings Ltd. Reg.S. v.16(2024) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 65,0150 | 650.150,00 | 0,23 |
| XS2116503546 | 1,125 % Amplifon S.p.A. Reg.S. v.20(2027) | 3.500.000 | 0 | 3.500.000 | 89,0000 | 3.115.000,00 | 1,12 |
| XS2111944992 | 2,000 % Arena Luxembourg Finance S.à r.l. Reg.S. v.20(2027) | 1.300.000 | 0 | 1.300.000 | 93,5000 | 1.215.500,00 | 0,44 |
| XS2111944133 | 1,875 % Arena Luxembourg Finance S.à r.l. Reg.S. v.20(2028) | 1.800.000 | 0 | 1.800.000 | 85,3060 | 1.535.508,00 | 0,55 |
| XS2103218538 | 2,000 % Ashland Services B.V. Reg.S. v.20(2028) | 700.000 | 0 | 700.000 | 87,1940 | 610.358,00 | 0,22 |
| XS2080318053 | 1,500 % Ball Corporation v.19(2027) | 5.600.000 | 3.000.000 | 2.600.000 | 88,9940 | 2.313.844,00 | 0,83 |
| XS1713858576 | 3,500 % Bormioli Pharma Bidco S.R.L. Reg.S. FRN v. 17(2024) | 0 | 0 | 650.000 | 81,8400 | 531.960,00 | 0,19 |
| XS1600514696 | 6,000 % BURGER KING France SAS Reg.S. v.17(2024) | 0 | 0 | 2.000.000 | 75,1450 | 1.502.900,00 | 0,54 |
| XS1729972015 | 5,250 % CeramTec BondCo GmbH Reg.S. v.17(2025) | 0 | 0 | 2.800.000 | 88,1690 | 2.468.732,00 | 0,89 |
| XS2033245023 | 3,625 % Cirsia Finance International S.à r.l. Reg.S. FRN v.19(2025) | 0 | 0 | 1.100.000 | 66,0000 | 726.000,00 | 0,26 |
| XS1849558900 | 6,250 % Cirsia Finance International S.à r.l. Reg.S. v.18(2023) | 0 | 0 | 600.000 | 67,0000 | 402.000,00 | 0,14 |
| XS2134245138 | 1,750 % Coca-Cola European Partners Plc. Reg.S. v.20(2026) | 300.000 | 0 | 300.000 | 101,6750 | 305.025,00 | 0,11 |
| XS1599406839 | 3,250 % Colfax Corporation Reg.S. v.17(2025) | 0 | 0 | 1.200.000 | 76,6060 | 919.272,00 | 0,33 |
| XS1713568811 | 4,250 % Constellium SE Reg.S. v.17(2026) | 300.000 | 0 | 800.000 | 75,8700 | 606.960,00 | 0,22 |
| XS1436943309 | 5,500 % Cott Finance Corporation Reg.S. v.16(2024) | 0 | 0 | 700.000 | 99,4220 | 695.954,00 | 0,25 |
| XS1801788305 | 4,750 % Coty Inc. Reg.S. v.18(2026) | 0 | 0 | 1.500.000 | 81,6300 | 1.224.450,00 | 0,44 |
| XS1227287221 | 3,375 % Crown European Holdings S.A. Reg.S. v.15(2025) | 0 | 0 | 700.000 | 99,4310 | 696.017,00 | 0,25 |
| XS1758716085 | 2,250 % Crown European Holdings S.A. Reg.S. v.18(2023) | 0 | 0 | 600.000 | 98,3060 | 589.836,00 | 0,21 |
| XS1758723883 | 2,875 % Crown European Holdings S.A. Reg.S. v.18(2026) | 0 | 0 | 500.000 | 95,1370 | 475.685,00 | 0,17 |
| DE000A2YPAK1 | 1,875 % DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG Reg.S. v.19(2024) | 10.200.000 | 2.000.000 | 8.200.000 | 85,5000 | 7.011.000,00 | 2,52 |
| XS1841967356 | 7,000 % DKT Finance ApS Reg.S. v.18(2023) | 0 | 0 | 2.100.000 | 89,9710 | 1.889.391,00 | 0,68 |
| XS1251078009 | 6,250 % Douglas GmbH Reg.S. v.15(2022) ²⁾ | 2.000.000 | 0 | 2.500.000 | 55,9450 | 1.398.625,00 | 0,50 |
| XS1699848914 | 2,500 % Dufry One BV Reg.S. v.17(2024) ²⁾ | 1.500.000 | 0 | 5.500.000 | 80,2350 | 4.412.925,00 | 1,59 |
| XS1703900164 | 2,375 % EC Finance Plc. Reg.S. v.17(2022) | 0 | 0 | 100.000 | 86,1780 | 86.178,00 | 0,03 |
| XS1983375871 | 4,000 % Europcar Mobility Group S.A. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 500.000 | 1.300.000 | 44,0000 | 572.000,00 | 0,21 |
| NO0010874548 | 3,375 % Explorer II AS v.20(2025) | 3.900.000 | 1.668.449 | 2.231.551 | 58,7510 | 1.311.058,53 | 0,47 |
| XS1987729412 | 1,875 % Fnac Darty Reg.S. v.19(2024) | 0 | 2.000.000 | 900.000 | 86,1930 | 775.737,00 | 0,28 |
| XS1987729768 | 2,625 % Fnac Darty Reg.S. v.19(2026) | 0 | 1.000.000 | 600.000 | 83,8510 | 503.106,00 | 0,18 |
| XS1333193875 | 3,750 % Goodyear Dunlop Tires Europe BV Reg.S. v.15(2023) | 0 | 0 | 600.000 | 77,8760 | 467.256,00 | 0,17 |
| XS2077646391 | 2,250 % Grifols S.A. Reg.S. v.19(2027) | 9.400.000 | 7.400.000 | 2.000.000 | 96,7600 | 1.935.200,00 | 0,70 |
| XS1812087598 | 3,375 % Grupo Antolin Irausa S.A. Reg.S. v.18(2026) | 500.000 | 0 | 500.000 | 66,5000 | 332.500,00 | 0,12 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾ |
|--------------|---|-----------|-----------|-----------|----------|-----------------------|---|
| | | | | | | EUR | |
| XS1888268064 | 3,500 % Guala Closures S.p.A. Reg.S. FRN v.18(2024) | 0 | 0 | 1.000.000 | 88,5000 | 885.000,00 | 0,32 |
| XS1419661118 | 3,500 % Hanesbrands Finance Luxembourg S.C.A. Reg.S. v.16(2024) | 0 | 0 | 600.000 | 98,9610 | 593.766,00 | 0,21 |
| XS2108560306 | 2,250 % INEOS Styrolution Group GmbH Reg.S. v.20(2027) | 500.000 | 0 | 500.000 | 75,0000 | 375.000,00 | 0,13 |
| XS2009038113 | 3,500 % International Game Technology Plc. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 0 | 1.100.000 | 75,2050 | 827.255,00 | 0,30 |
| XS1551347393 | 2,200 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. Reg.S. v.17(2024) | 0 | 0 | 250.000 | 67,0000 | 167.500,00 | 0,06 |
| XS2010037682 | 6,875 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. Reg.S. v.19(2026) | 500.000 | 0 | 500.000 | 71,7500 | 358.750,00 | 0,13 |
| DE000A2NB965 | 5,500 % KAEFER Isoliertechnik GMBH & Co KG Reg.S. v.18(2024) | 0 | 0 | 5.200.000 | 75,0000 | 3.900.000,00 | 1,40 |
| XS2010034077 | 3,375 % Kapla Holding S.A.S. Reg.S. v.19(2026) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 62,0000 | 620.000,00 | 0,22 |
| XS1251078694 | 8,750 % Kirk Beauty One GmbH Reg.S. v.15(2023) | 3.500.000 | 3.100.000 | 4.350.000 | 39,0000 | 1.696.500,00 | 0,61 |
| XS1756722069 | 6,750 % KME SE Reg.S. v.18(2023) ²⁾ | 1.500.000 | 0 | 4.900.000 | 50,0600 | 2.452.940,00 | 0,88 |
| XS1405784015 | 2,250 % Kraft Heinz Foods Co. Reg.S. v.16(2028) | 6.000.000 | 5.280.000 | 2.000.000 | 85,8830 | 1.717.660,00 | 0,62 |
| XS1602130947 | 3,375 % Levi Strauss & Co. v.17(2027) | 0 | 0 | 100.000 | 93,4110 | 93.411,00 | 0,03 |
| XS1401324972 | 3,500 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.16(2023) | 0 | 0 | 400.000 | 87,0070 | 348.028,00 | 0,13 |
| XS2031870921 | 3,250 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.19(2025) | 0 | 0 | 700.000 | 80,2420 | 561.694,00 | 0,20 |
| XS2031871069 | 3,750 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 0 | 1.200.000 | 80,5000 | 966.000,00 | 0,35 |
| XS2031871143 | 5,750 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.19(2027) ²⁾ | 1.000.000 | 1.000.000 | 3.600.000 | 52,1720 | 1.878.192,00 | 0,67 |
| XS1278084147 | 4,000 % MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corporation v.15(2022) | 0 | 2.000.000 | 2.800.000 | 101,9350 | 2.854.180,00 | 1,03 |
| XS1523028436 | 3,325 % MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corporation v.17(2025) | 0 | 1.000.000 | 2.400.000 | 97,5100 | 2.340.240,00 | 0,84 |
| XS1690644668 | 3,500 % Nidda Healthcare Holding GmbH Reg.S. v.17(2024) | 7.800.000 | 6.500.000 | 2.800.000 | 92,6970 | 2.595.516,00 | 0,93 |
| XS1713466149 | 4,500 % Novafives S.A.S. Reg.S. FRN v.18(2025) | 0 | 1.000.000 | 440.000 | 53,1830 | 234.005,20 | 0,08 |
| XS2066213625 | 3,125 % OCI NV Reg.S. v.19(2024) | 9.100.000 | 2.000.000 | 7.100.000 | 86,2290 | 6.122.259,00 | 2,20 |
| XS2077666316 | 2,875 % Ol European Group BV Reg.S. Green Bond v.19(2025) | 6.600.000 | 2.000.000 | 4.600.000 | 93,1040 | 4.282.784,00 | 1,54 |
| XS0908230781 | 4,875 % Ol European Group BV Reg.S. v.13(2021) | 0 | 128.485 | 71.515 | 99,1360 | 70.897,23 | 0,03 |
| XS1517169972 | 4,375 % Parts Europe S.A. Reg.S. FRN v.16(2022) | 0 | 0 | 516.117 | 76,7160 | 395.943,94 | 0,14 |
| XS1517169899 | 4,375 % Parts Europe S.A. Reg.S. v.16(2022) | 0 | 0 | 700.000 | 84,9320 | 594.524,00 | 0,21 |
| XS2010038060 | 3,500 % Peach Property Finance GmbH Reg.S. v.19(2023) | 2.700.000 | 1.500.000 | 1.200.000 | 97,0000 | 1.164.000,00 | 0,42 |
| XS1091770161 | 3,625 % PHOENIX PIB Dutch Finance BV Reg.S. v.14(2021) | 0 | 0 | 2.182.000 | 100,7500 | 2.198.365,00 | 0,79 |
| XS2078976805 | 2,125 % PPF Telecom Group BV EMTN Reg.S. v.19(2025) | 3.400.000 | 1.000.000 | 2.400.000 | 93,2270 | 2.237.448,00 | 0,80 |
| XS1729059862 | 6,375 % Raffinerie Heide GmbH Reg.S. v.17(2022) ²⁾ | 4.000.000 | 0 | 9.250.000 | 57,9980 | 5.364.815,00 | 1,93 |
| XS1383922876 | 4,000 % Sappi Papier Holding GmbH Reg.S. v.16(2023) | 0 | 0 | 2.300.000 | 88,5650 | 2.036.995,00 | 0,73 |
| XS1961852750 | 3,125 % Sappi Papier Holding GmbH Reg.S. v.19(2026) ²⁾ | 3.900.000 | 4.500.000 | 2.400.000 | 72,3240 | 1.735.776,00 | 0,62 |
| XS1454980159 | 7,000 % Sisal Group S.p.A. Reg.S. v.16(2023) | 0 | 218.750 | 481.250 | 83,1170 | 400.000,56 | 0,14 |
| XS1555147369 | 2,375 % Smurfit Kappa Acquisitions Unlimited Co. Reg.S. v.17(2024) | 0 | 0 | 2.900.000 | 100,2650 | 2.907.685,00 | 1,04 |
| XS1221105759 | 2,875 % SPCM S.A. Reg.S. v.15(2023) | 2.500.000 | 1.500.000 | 9.689.000 | 94,3370 | 9.140.311,93 | 3,28 |
| XS1885682036 | 6,500 % Starfruit Finco BV/Starfruit US Holdco LLC Reg.S. v.18(2026) | 0 | 0 | 500.000 | 79,1760 | 395.880,00 | 0,14 |
| XS2110768525 | 3,750 % Stena International S.A. Reg.S. v.20(2025) | 500.000 | 0 | 500.000 | 81,0000 | 405.000,00 | 0,15 |
| XS1516322200 | 3,500 % Synlab Bondco Plc. Reg.S. FRN v.16(2022) | 0 | 0 | 6.400.000 | 93,3760 | 5.976.064,00 | 2,15 |
| XS1859258383 | 6,000 % Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH Reg.S. v.18(2026) | 0 | 1.000.000 | 1.400.000 | 92,6010 | 1.296.414,00 | 0,47 |
| XS2090816526 | 2,000 % Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH Reg.S. v.20(2025) | 4.100.000 | 1.000.000 | 3.100.000 | 93,5150 | 2.898.965,00 | 1,04 |
| XS1827600724 | 4,000 % The Chemours Co. v.18(2026) | 500.000 | 1.000.000 | 1.000.000 | 66,0000 | 660.000,00 | 0,24 |
| XS2034069836 | 3,750 % Trivium Packaging Finance BV Reg.S. FRN v.19(2026) | 0 | 0 | 600.000 | 87,6750 | 526.050,00 | 0,19 |
| XS2034068432 | 3,750 % Trivium Packaging Finance BV Reg.S. v.19(2026) | 0 | 0 | 700.000 | 91,6370 | 641.459,00 | 0,23 |
| XS1504103984 | 2,125 % TUI AG Reg.S. v.16(2021) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | 88,0650 | 880.650,00 | 0,32 |
| XS2111947318 | 3,250 % United Group B.V. EO-FLR Notes 2020(20/26) Reg.S | 200.000 | 0 | 200.000 | 78,8880 | 157.776,00 | 0,06 |
| XS2111946930 | 3,125 % United Group BV Reg.S. v.20(2026) | 500.000 | 0 | 500.000 | 84,4610 | 422.305,00 | 0,15 |
| XS2111947748 | 3,625 % United Group BV Reg.S. v.20(2028) | 400.000 | 0 | 400.000 | 81,2370 | 324.948,00 | 0,12 |
| XS1117297603 | 4,000 % UPCB Finance IV Ltd. Reg.S. v.15(2027) | 0 | 0 | 90.000 | 98,3060 | 88.475,40 | 0,03 |
| XS1634252628 | 3,625 % UPCB Finance VII Ltd. Reg.S. v.17(2029) | 0 | 1.000.000 | 1.500.000 | 91,1930 | 1.367.895,00 | 0,49 |
| XS1720016531 | 5,750 % Verisure Midholding AB Reg.S. v.17(2023) | 0 | 1.500.000 | 167.000 | 87,3200 | 145.824,40 | 0,05 |
| DE000A254QC5 | 2,875 % Wepa Hygieneprodukte GmbH FLR-Anleihe v.19(19/26)Reg.S | 500.000 | 0 | 500.000 | 88,4320 | 442.160,00 | 0,16 |
| DE000A254QA9 | 2,875 % Wepa Hygieneprodukte GmbH Reg.S. v.19(2027) | 5.750.000 | 2.000.000 | 3.750.000 | 91,5430 | 3.432.862,50 | 1,23 |
| XS1505573995 | 4,125 % WMG Acquisition Corporation Reg.S. v.16(2024) | 0 | 900.000 | 2.700.000 | 100,7180 | 2.719.386,00 | 0,98 |
| XS1891203546 | 3,625 % WMG Acquisition Corporation Reg.S. v.18(2026) | 0 | 0 | 1.600.000 | 100,0000 | 1.600.000,00 | 0,57 |
| XS2116386132 | 3,375 % Ziggo Bond Co. BV Reg.S. v.20(2030) | 5.700.000 | 1.000.000 | 4.700.000 | 89,9180 | 4.226.146,00 | 1,52 |
| XS1577949149 | 4,000 % 3AB Optique Developpment S.A.S. Reg.S. v.17(2023) | 0 | 0 | 800.000 | 68,2510 | 546.008,00 | 0,20 |
| XS1577948687 | 4,125 % 3AB Optique Developpment S.A.S. Reg.S. v.17(2023) | 0 | 0 | 1.414.286 | 69,8870 | 988.401,86 | 0,36 |
| | | | | | | 135.540.239,55 | 48,70 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert EUR | Anteil am Fonds- vermögen % 1) |
|---|---|------------|------------|-------------|----------|-----------------------|---|
| GBP | | | | | | | |
| XS1602280676 | 4,250 % Drax Finco Plc. Reg.S. v.17(2022) | 0 | 0 | 1.700.000 | 93,5440 | 1.797.702,92 | 0,65 |
| XS1555825378 | 2,750 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. Reg.S. v.17(2021) | 0 | 0 | 750.000 | 94,0000 | 796.970,38 | 0,29 |
| XS1756633126 | 6,375 % Pinnacle Bidco Plc. Reg.S. v.18(2025) | 0 | 0 | 1.300.000 | 67,1400 | 986.683,25 | 0,35 |
| | | | | | | 3.581.356,55 | 1,29 |
| USD | | | | | | | |
| US233851CY88 | 2,200 % Daimler Finance North America LLC 144A v.17(2020) | 5.000.000 | 0 | 7.570.000 | 99,7865 | 6.885.277,60 | 2,47 |
| US31562QAC15 | 4,500 % Fiat Chrysler Automobiles NV v.15(2020) | 1.000.000 | 0 | 10.000.000 | 99,7410 | 9.091.331,67 | 3,27 |
| US345397XK41 | 3,157 % Ford Motor Credit Co. LLC v.15(2020) | 0 | 1.000.000 | 4.100.000 | 97,6465 | 3.649.171,91 | 1,31 |
| USN82008AM02 | 3,300 % Siemens Financieringsmaatschappij NV Reg.S. v.16(2046) | 0 | 0 | 700.000 | 100,6545 | 642.221,77 | 0,23 |
| USN88808AB12 | 8,500 % Trivium Packaging Finance BV Reg.S. v.19(2027) | 0 | 0 | 300.000 | 100,5000 | 274.815,42 | 0,10 |
| | | | | | | 20.542.818,37 | 7,38 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | | | 159.664.414,47 | 57,37 |
| Neuemissionen, die zum Handel an einem organisierten Markt vorgesehen sind | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| XS2071622216 | 0,750 % Crown European Holdings S.A. Reg.S. v.19(2023) | 3.200.000 | 3.000.000 | 200.000 | 94,7500 | 189.500,00 | 0,07 |
| XS2010033269 | 3,250 % Kapla Holding S.A.S EO-FLR Nts 2019(19/26) Reg.S | 4.200.000 | 0 | 4.200.000 | 65,4380 | 2.748.396,00 | 0,99 |
| | | | | | | 2.937.896,00 | 1,06 |
| Neuemissionen, die zum Handel an einem organisierten Markt vorgesehen sind | | | | | | 2.937.896,00 | 1,06 |
| Anleihen | | | | | | 230.707.953,36 | 82,88 |
| Wertpapiervermögen | | | | | | 230.707.953,36 | 82,88 |
| Optionen | | | | | | | |
| Short-Positionen | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| | Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/2,125 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | 0,00 | 0,00 |
| | Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,000 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | -1.420,00 | 0,00 |
| | Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,125 | 0 | 30.000.000 | -30.000.000 | | -3.540,00 | 0,00 |
| | Call on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/2,125 | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | 0,00 | 0,00 |
| | Call on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,125 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | -2.360,00 | 0,00 |
| | Call on BofA Securities Europe S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,125 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | -2.360,00 | 0,00 |
| | Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/2,125 | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | 0,00 | 0,00 |
| | Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,125 | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -1.180,00 | 0,00 |
| | Call on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/2,125 | 0 | 30.000.000 | -30.000.000 | | -3.540,00 | 0,00 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Juni 2020/4,250 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | -1.475.440,00 | -0,53 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Juni 2020/4,750 | 0 | 20.000.000 | -20.000.000 | | -1.239.640,00 | -0,45 |
| | | | | | | -2.729.480,00 | -0,98 |
| Short-Positionen | | | | | | -2.729.480,00 | -0,98 |
| Optionen | | | | | | -2.729.480,00 | -0,98 |
| Terminkontrakte | | | | | | | |
| Short-Positionen | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| | EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2020 | 420 | 450 | -30 | | 7.200,00 | 0,00 |
| | | | | | | 7.200,00 | 0,00 |
| Short-Positionen | | | | | | 7.200,00 | 0,00 |
| Terminkontrakte | | | | | | 7.200,00 | 0,00 |
| Credit Default Swaps | | | | | | | |
| Gekauft | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| | Barclays Bank Plc./Hema Bondco I BV CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 1.000.000 | | 458.604,50 | 0,16 |
| | Barclays Bank Plc./Leonardo S.p.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 4.000.000 | | -423.671,56 | -0,15 |
| | Barclays Bank Plc./Volvo Treasury AB EMTN CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 5.000.000 | | -61.005,95 | -0,02 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 70.000.000 | 50.000.000 | 20.000.000 | | -37.841,20 | -0,01 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾ |
|-----------------|--|-------------|------------|-------------|------|--------------------|---|
| | | | | | | EUR | |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 70.000.000 | 0 | 70.000.000 | | -132.444,20 | -0,05 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Xover S23 5 Yr Index CDS v.20(2020) | 20.000.000 | 0 | 20.000.000 | | -60.131,80 | -0,02 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Telecom Italia S.p.A. CDS v.19(2024) | 3.000.000 | 0 | 3.000.000 | | 223.265,79 | 0,08 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/TUI AG CDS v.20(2020) | 1.000.000 | 0 | 1.000.000 | | 41.664,25 | 0,01 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Enel S.p.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 3.000.000 | | -32.286,87 | -0,01 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./LafargeHolcim Ltd. CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 5.000.000 | | 32.380,55 | 0,01 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./LafargeHolcim Ltd. v.12(2022) CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 2.000.000 | | 12.952,24 | 0,00 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./LANXESS AG CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 5.000.000 | | -31.558,85 | -0,01 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Stora Enso Oyj EMTN Reg.S. v.16(2023) CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 3.000.000 | | -453.098,01 | -0,16 |
| | Credit Suisse International, London/LANXESS AG CDS v.19(2024) | 5.000.000 | 0 | 5.000.000 | | -4.093,35 | 0,00 |
| | Dte. Bank AG, Frankfurt am Main/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 150.000.000 | 0 | 150.000.000 | | -283.809,00 | -0,10 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Telecom Italia S.p.A. CDS v.20(2024) | 3.000.000 | 0 | 3.000.000 | | 223.265,79 | 0,08 |
| | Goldman Sachs Bank Europe SE/ENI S.p.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 5.000.000 | | 71.700,90 | 0,03 |
| | Goldman Sachs International., London/Fiat Chrysler Automobiles CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 2.000.000 | | -46.298,44 | -0,02 |
| | Goldman Sachs International., London/Volvo Treasury AB EMTN CDS v.18(2023) | 0 | 0 | 5.000.000 | | -61.005,95 | -0,02 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./ArcelorMittal S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 3.000.000 | | -51.762,96 | -0,02 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 80.000.000 | 0 | 80.000.000 | | -151.364,80 | -0,05 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./LafargeHolcim Ltd. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 4.000.000 | | 53.047,88 | 0,02 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./LANXESS AG CDS v.19(2024) | 5.000.000 | 0 | 5.000.000 | | -4.093,35 | 0,00 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt/CNH Industrial Finance Europe S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 3.000.000 | | -382.227,06 | -0,14 |
| | J.P. Morgan AG, Frankfurt/Fiat Chrysler Automobiles NV CDS v.19(2024) | 0 | 0 | 3.000.000 | | -52.558,26 | -0,02 |
| | J.P. Morgan Securities Plc., London/Enel S.p.A. CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 4.000.000 | | -51.751,12 | -0,02 |
| | J.P. Morgan Securities Plc., London/LafargeHolcim Ltd. CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 2.000.000 | | 12.952,24 | 0,00 |
| | J.P. Morgan Securities Plc., London/Valéo S.A. CDS v.19(2023) | 0 | 0 | 5.000.000 | | 282.331,00 | 0,10 |
| | | | | | | -908.837,59 | -0,33 |
| | | | | | | -908.837,59 | -0,33 |
| Gekauft | | | | | | | |
| Verkauft | | | | | | | |
| EUR | | | | | | | |
| | Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/TDC A/S CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -2.000.000 | | -89.061,52 | -0,03 |
| | Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/thyssenkrupp AG CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -3.000.000 | | -458.264,19 | -0,16 |
| | Barclays Bank Plc., London/Novafives S.A.S. CDS v.15(2020) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -74.514,34 | -0,03 |
| | Barclays Bank Plc./Auchan Holding S.A. EMTN CDS v.18(2023) | 0 | 0 | -2.000.000 | | -36.077,46 | -0,01 |
| | Barclays Bank Plc./TDC A/S CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -4.000.000 | | -178.123,04 | -0,06 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Altice France S.A. CDS v.20(2025) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | 40.719,77 | 0,01 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Auchan Holding S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | -165.629,13 | -0,06 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Auchan Holding S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | -165.629,13 | -0,06 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -221.762,62 | -0,08 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Imperial Brands Finance Plc. CDS v.19(2024) | 0 | 2.000.000 | -2.000.000 | | 1.893,12 | 0,00 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Ses S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 | -5.000.000 | | -100.321,05 | -0,04 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Syngenta Finance NV CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | -205.086,33 | -0,07 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Tesco Plc. CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | 634,38 | 0,00 |
| | Citibank Europe Plc., Dublin/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| | Citibank Europe Plc., Dublin/Nokia Oyj CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | 455.086,20 | 0,16 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Casino Guichard-Perrachon S.A. Reg.S. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -221.762,62 | -0,08 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Tesco Plc. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -2.000.000 | | 9.823,46 | 0,00 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Tesco Plc. CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | 4.911,73 | 0,00 |
| | Credit Suisse International, London/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| | Credit Suisse International, London/TDC A/S CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -5.000.000 | | -222.653,80 | -0,08 |
| | Credit Suisse International, London/thyssenkrupp AG CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -170.859,92 | -0,06 |
| | Credit Suisse International, London/TUI AG CDS v.20(2029) | 0 | 2.000.000 | -2.000.000 | | -296.893,68 | -0,11 |
| | Dte. Bank AG, Frankfurt am Main/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| | Dte. Bank AG, Frankfurt am Main/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Fortum Oyj CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 | -5.000.000 | | 42.250,35 | 0,02 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./K+S Aktiengesellschaft CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -319.651,04 | -0,11 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./K+S Aktiengesellschaft CDS v.19(2024) | 0 | 0 | -1.000.000 | | -319.651,04 | -0,11 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./K+S Aktiengesellschaft CDS v.19(2024) | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -188.360,15 | -0,07 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Nokia Oyj CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | 455.086,20 | 0,16 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge | Bestand | Kurs | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % ¹⁾ |
|--|-------------|-----------|------------|-------------|------|-----------------------|---|
| | | | | | | EUR | |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Nokia Oyj CDS v.19(2024) | | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | 455.086,20 | 0,16 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Renault S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 5.000.000 | -5.000.000 | | -476.421,80 | -0,17 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Ses S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 2.000.000 | -2.000.000 | | -40.128,42 | -0,01 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./thyssenkrupp AG CDS v.19(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -170.859,92 | -0,06 |
| Goldman Sachs Intl., London/Tesco Plc. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | 4.911,73 | 0,00 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Atlantia S.p.A. CDS v.20(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -199.118,12 | -0,07 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Auchan Holding S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | -42.166,75 | -0,02 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Auchan Holding S.A. CDS v.20(2024) | | 0 | 3.000.000 | -3.000.000 | | -165.629,13 | -0,06 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -99.158,77 | -0,04 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | -221.762,62 | -0,08 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | | 0 | 10.000.000 | -10.000.000 | | -254.196,10 | -0,09 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | | 0 | 30.000.000 | -30.000.000 | | 95.940,30 | 0,03 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./K+S Aktiengesellschaft CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -5.000.000 | | -891.061,55 | -0,32 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Ses S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -4.000.000 | | -55.379,72 | -0,02 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt/Altice France S.A. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | 66.299,72 | 0,02 |
| J.P. Morgan Securities Plc., London/Cellnex Telecom S.A. CDS v.19(2023) | | 0 | 0 | -5.000.000 | | 592.783,05 | 0,21 |
| J.P. Morgan Securities Plc., London/Cellnex Telecom S.A. EMTN CDS v.18(2022) | | 0 | 0 | -3.000.000 | | 302.278,86 | 0,11 |
| J.P. Morgan Securities Plc., London/Elis S.A. CDS v.17(2022) | | 0 | 0 | -4.000.000 | | 220.054,52 | 0,08 |
| | | | | | | -5.069.198,72 | -1,85 |
| USD | | | | | | | |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/AT & T Inc. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -5.000.000 | | -169.028,71 | -0,06 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.20(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| Citigroup Global Markets Ltd., London/AT & T Inc. CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -3.000.000 | | -101.417,23 | -0,04 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Griechenland CDS v.20(2020) | | 2.000.000 | 10.000.000 | -8.000.000 | | 11.655,16 | 0,00 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.20(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.20(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.20(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| Goldman Sachs International., London/Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.18(2023) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | -79.446,01 | -0,03 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.19(2024) | | 0 | 0 | -1.000.000 | | -95.767,80 | -0,03 |
| J.P. Morgan AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.19(2024) | | 0 | 1.000.000 | -1.000.000 | | -116.550,80 | -0,04 |
| | | | | | | -1.133.309,39 | -0,40 |
| | | | | | | -6.202.508,11 | -2,25 |
| | | | | | | -7.111.345,70 | -2,58 |
| Bankguthaben - Kontokorrent | | | | | | 23.177.329,82 | 8,33 |
| Sonstige Vermögensgegenstände/Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | | 34.267.896,23 | 12,35 |
| Fondsvermögen in EUR | | | | | | 278.319.553,71 | 100,00 |

- 1) Aufgrund von Rundungsdifferenzen in den Einzelpositionen können die Summen vom tatsächlichen Wert abweichen.
2) Die gekennzeichneten Wertpapiere sind ganz oder teilweise verliehen.

Devisentermingeschäfte

Zum 31.03.2020 standen folgende offene Devisentermingeschäfte aus:

| Währung | | Währungsbetrag | Kurswert | Anteil am Fondsvermögen % |
|---------|------------------|----------------|---------------|---------------------------|
| | | | EUR | |
| EUR/GBP | Währungsverkäufe | 3.000.000,00 | 3.390.075,67 | 1,22 |
| EUR/USD | Währungsverkäufe | 30.000.000,00 | 27.322.354,60 | 9,82 |

Devisenkurse

Für die Bewertung von Vermögenswerten in fremder Währung wurde zum nachstehenden Devisenkurs zum 31. März 2020 in Euro umgerechnet.

| | | | |
|--------------------------|-----|---|--------|
| Britisches Pfund | GBP | 1 | 0,8846 |
| Schweizer Franken | CHF | 1 | 1,0614 |
| US Amerikanischer Dollar | USD | 1 | 1,0971 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

Zu- und Abgänge vom 1. Oktober 2019 bis 31. März 2020

Während des Berichtszeitraumes getätigte Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Schuldscheindarlehen und Derivaten, einschließlich Änderungen ohne Geldbewegungen, soweit sie nicht in der Vermögensaufstellung genannt sind.

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|-------------------------------------|--|-----------|-----------|
| Anleihen | | | |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | |
| CHF | | | |
| XS1756227309 | 5,875 % Selecta Group BV Reg.S. v.18(2024) | 0 | 2.000.000 |
| EUR | | | |
| XS2055646918 | 0,750 % AbbVie Inc. v.19(2027) | 0 | 1.000.000 |
| XS2055647213 | 1,250 % AbbVie Inc. v.19(2031) | 0 | 3.500.000 |
| XS2101336316 | 0,375 % ABN AMRO Bank NV Reg.S. Pfe. v.20(2035) | 800.000 | 800.000 |
| FR0013399029 | 1,750 % ACCOR S.A. v.19(2026) | 0 | 200.000 |
| FR0013453040 | 0,250 % Alstom S.A. EMTN v.19(2026) | 1.800.000 | 1.800.000 |
| XS1664644983 | 2,250 % B.A.T. International Finance Plc. EMTN Reg.S. v.17(2030) | 2.000.000 | 2.000.000 |
| BE0000350596 | 0,400 % Belgien Reg.S. v.20(2040) | 1.800.000 | 1.800.000 |
| DE000A1ROTU2 | 2,375 % Bilfinger SE Reg.S. v.12(2019) | 0 | 4.089.000 |
| XS2055728054 | 0,375 % BMW Finance NV EMTN Reg.S. v.19(2027) | 0 | 1.000.000 |
| XS1531338678 | 4,750 % Catalent Pharma Solutions Inc. Reg.S. v.16(2020) | 0 | 2.600.000 |
| XS2057070182 | 1,500 % CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. Reg.S. v.19(2031) | 2.800.000 | 2.800.000 |
| XS2056572154 | 0,375 % CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. v.19(2023) | 2.300.000 | 2.300.000 |
| XS2057069093 | 0,750 % CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. v.19(2026) | 3.200.000 | 3.200.000 |
| XS2057069762 | 1,125 % CK Hutchison Group Telecom Finance S.A. v.19(2028) | 2.500.000 | 2.500.000 |
| FR0013135282 | 0,250 % Compagnie de Financement Foncier EMTN Reg.S. Pfe. v.16(2022) | 0 | 100.000 |
| XS2056430874 | 0,375 % Continental AG EMTN Reg.S. v.19(2025) | 0 | 2.200.000 |
| IT0005397036 | 1,000 % Credit Agricole Cariparma S.p.A. Reg.S. Pfe. v.20(2045) | 2.000.000 | 2.000.000 |
| XS1490137418 | 2,625 % Crown European Holdings S.A. Reg.S. v.16(2024) | 0 | 1.400.000 |
| DE000A2R9ZT1 | 0,250 % Daimler International Finance BV EMTN Reg.S. v.19(2023) | 3.200.000 | 3.200.000 |
| XS1813579593 | 3,625 % Darling Global Finance BV Reg.S. v.18(2026) | 4.000.000 | 4.000.000 |
| FR0013444551 | 0,375 % Dassault Systemes SE Reg.S. v.19(2029) | 0 | 200.000 |
| XS1405770576 | 5,000 % DIGI Communications NV Reg.S. v.16(2020) | 0 | 3.600.000 |
| DE000DHY5074 | 0,010 % Dte. Hypothekbank [A.-G.] Pfe. v.20(2027) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| XS2075938006 | 1,700 % Eli Lilly and Company v.19(2049) | 2.900.000 | 2.900.000 |
| BE0002629104 | 1,375 % Elia Group EMTN Reg.S. v.19(2026) | 0 | 800.000 |
| FR0013318102 | 2,875 % Elis S.A. EMTN Reg.S. v.18(2026) | 0 | 1.200.000 |
| FR0013413556 | 1,750 % Elis S.A. EMTN Reg.S. v.19(2024) | 0 | 3.600.000 |
| FR0013449972 | 1,000 % Elis S.A. EMTN Reg.S. v.19(2025) | 0 | 3.100.000 |
| FR0013449998 | 1,625 % Elis S.A. EMTN Reg.S. v.19(2028) | 0 | 2.200.000 |
| FR0013455813 | 0,500 % Engie S.A. EMTN Reg.S. Green Bond v.19(2030) | 1.100.000 | 1.100.000 |
| FR0013455821 | 1,250 % Engie S.A. Reg.S. Green Bond v.19(2041) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS2047500926 | 0,350 % E.ON SE EMTN Reg.S. Green Bond v.19(2030) | 0 | 500.000 |
| XS2103015009 | 0,000 % E.ON SE EMTN Reg.S. v.20(2023) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| XS2103014457 | 0,750 % E.ON SE EMTN Reg.S. v.20(2030) | 700.000 | 700.000 |
| AT0000A2CDT6 | 0,100 % Erste Group Bank AG EMTN Reg.S. Pfe. v.20(2030) | 500.000 | 500.000 |
| FR0013463668 | 0,000 % EssilorLuxottica S.A. EMTN Reg.S. v.19(2027) | 1.500.000 | 1.500.000 |
| XS2084488209 | 1,250 % Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA EMTN Reg.S. v.19(2029) | 2.200.000 | 2.200.000 |
| XS2101357072 | 0,750 % Fresenius SE & Co. KGaA EMTN Reg.S. v.20(2028) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| XS2029713349 | 1,125 % GELF Bond Issuer I S.A. EMTN Reg.S. v.19(2029) | 0 | 1.600.000 |
| XS2054626358 | 0,204 % GlaxoSmithKline Capital Plc. EMTN FRN v.19(2021) | 0 | 1.500.000 |
| GR0124035693 | 3,875 % Griechenland Reg.S. v.19(2029) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS1647645081 | 8,500 % HEMA Bondco II BV Reg.S. v.17(2023) | 0 | 1.100.000 |
| XS2081615473 | 0,500 % Holcim Finance [Luxembourg] S.A. EMTN Reg.S. v.19(2026) | 3.200.000 | 3.200.000 |
| DE000A1R02E0 | 3,875 % HORNBACH Baumarkt AG Reg.S. v.13(2020) | 0 | 5.400.000 |
| XS1951313680 | 1,125 % Imperial Brands Finance Plc. EMTN v.19(2023) | 0 | 200.000 |
| XS1951313763 | 2,125 % Imperial Brands Finance Plc. EMTN v.19(2027) | 0 | 3.000.000 |
| BE0002684653 | 0,010 % ING Belgium S.A./NV Reg.S. Pfe. v.20(2030) | 1.100.000 | 1.100.000 |
| XS2122894855 | 0,000 % International Bank for Reconstruction and Development v.20(2030) | 1.900.000 | 1.900.000 |
| IE00BKFCV345 | 0,400 % Irland Reg.S. v.20(2035) | 1.700.000 | 1.700.000 |
| XS2050543839 | 1,375 % ITV Plc. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 3.400.000 |
| DE000A254PP9 | 0,000 % Kreditanstalt für Wiederaufbau EMTN Reg.S. v.20(2027) | 2.400.000 | 2.400.000 |
| XS1680281133 | 3,750 % KRONOS INTERNATIONAL INC. Reg.S. v.17(2025) | 0 | 650.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|--|--|-----------|-----------|
| XS2056484889 | 0,010 % Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale Pfe. v.19(2029) | 0 | 1.000.000 |
| FR0013482809 | 0,200 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE EMTN Reg.S. FRN v.20(2022) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| FR0013482817 | 0,000 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE EMTN Reg.S. v.20(2024) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| FR0013482825 | 0,000 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE EMTN Reg.S. v.20(2026) | 2.400.000 | 2.400.000 |
| FR0013482833 | 0,125 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE Reg.S. v.20(2028) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| FR0013482841 | 0,000 % LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE Reg.S. v.20(2031) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| XS2064643484 | 4,500 % Motion Bondco DAC Reg.S. v.19(2027) | 600.000 | 600.000 |
| FR0010804500 | 4,875 % Orano S.A. EMTN v.09(2024) | 0 | 400.000 |
| XS2055106137 | 0,875 % OTE Plc. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 2.100.000 |
| FI4000331004 | 4,125 % Outokumpu Oyj Reg.S. v.18(2024) | 0 | 1.000.000 |
| PTOTEL0E0028 | 0,475 % Portugal Reg.S. v.20(2030) | 2.500.000 | 2.500.000 |
| XS1533933039 | 6,250 % PrestigeBidCo GmbH Reg.S. v.16(2023) | 0 | 600.000 |
| XS2100569552 | 0,375 % Raiffeisenlandesbank Niederösterreich-Wien AG Reg.S. Pfe. v.20(2035) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS1698063739 | 3,375 % RESIDOMO s.r.o. Reg.S. v.17(2020) | 4.000.000 | 8.600.000 |
| XS2063268754 | 1,250 % Royal Mail Plc. Reg.S. v.19(2026) | 1.700.000 | 1.700.000 |
| XS2114871945 | 1,000 % Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB EO-Med.-Term Notes 2020(2027) | 2.200.000 | 2.200.000 |
| XS2118276539 | 0,000 % Siemens Financieringsmaatschappij NV EMTN Reg.S. v.20(2023) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS2118280218 | 0,000 % Siemens Financieringsmaatschappij NV EMTN Reg.S. v.20(2026) | 2.400.000 | 2.400.000 |
| XS2118276026 | 0,250 % Siemens Financieringsmaatschappij NV EMTN Reg.S. v.20(2029) | 1.700.000 | 1.700.000 |
| SI0002103966 | 0,275 % Slowenien Reg.S. v.20(2030) | 1.400.000 | 1.400.000 |
| XS1648462023 | 2,250 % SNCF Réseau S.A. EMTN Reg.S. Green Bond v.17(2047) | 2.000.000 | 2.000.000 |
| BE6315847804 | 0,500 % Solvay S.A. Reg.S. v.19(2029) | 0 | 200.000 |
| XS1432392170 | 2,125 % Stora Enso Oyj EMTN Reg.S. v.16(2023) | 0 | 800.000 |
| FR0013452620 | 0,500 % Suez S.A. EMTN Reg.S. v.19(2031) | 2.200.000 | 2.200.000 |
| XS2117454871 | 0,875 % Telenor ASA EMTN Reg.S. v.20(2035) | 1.700.000 | 1.700.000 |
| XS1082971588 | 2,500 % Tesco Corporate Treasury Services Plc. EMTN Reg.S. v.14(2024) | 0 | 300.000 |
| XS1211040917 | 1,250 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV Reg.S. v.15(2023) | 0 | 1.000.000 |
| XS1211044075 | 1,875 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV Reg.S. v.15(2027) | 3.500.000 | 5.000.000 |
| XS1439749281 | 1,125 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV Reg.S. v.16(2024) | 1.000.000 | 2.000.000 |
| XS1439749364 | 1,625 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV Reg.S. v.16(2028) | 500.000 | 2.000.000 |
| XS2101325111 | 0,010 % The Bank of Nova Scotia Reg.S. Pfe. v.20(2027) | 700.000 | 700.000 |
| DE000A2YN6V1 | 1,875 % thyssenkrupp AG EMTN Reg.S. v.19(2023) | 0 | 2.200.000 |
| FR0013456621 | 0,875 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EMTN Reg.S. v.19(2032) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| FR0013431715 | 1,750 % Unibail-Rodamco-Westfield SE EMTN Reg.S. v.19(2049) | 0 | 1.800.000 |
| FR0012188456 | 2,250 % Vallourec S.A. Reg.S. v.14(2024) | 2.000.000 | 3.500.000 |
| FR0013424868 | 0,625 % Vivendi S.A. EMTN Reg.S. v.19(2025) | 0 | 900.000 |
| FR0013424876 | 1,125 % Vivendi S.A. EMTN Reg.S. v.19(2028) | 0 | 1.400.000 |
| XS2010039381 | 2,000 % ZF Europe Finance BV v.19(2026) | 900.000 | 900.000 |
| XS2010039977 | 2,500 % ZF Europe Finance BV v.19(2027) | 1.400.000 | 1.400.000 |
| XS2010039894 | 3,000 % ZF Europe Finance BV v.19(2029) | 900.000 | 900.000 |
| DE000A14J7G6 | 2,750 % ZF North America Capital Inc. Reg.S. v.15(2023) | 0 | 2.000.000 |
| XS2105095777 | 0,625 % Zypern EMTN Reg.S. v.20(2030) | 800.000 | 800.000 |
| XS2105097393 | 1,250 % Zypern EMTN Reg.S. v.20(2040) | 900.000 | 900.000 |
| GBP | | | |
| GB00B4RMG977 | 3,750 % Großbritannien Reg.S. v.11(2021) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| USD | | | |
| US037833BS85 | 2,250 % Apple Inc. v.16(2021) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| US0454935395 | 4,900 % EDP Finance B.V. Reg.S. v.09(2019) | 0 | 2.100.000 |
| US26835PAC41 | 4,900 % EDP Finance BV 144A v.09(2019) | 0 | 3.000.000 |
| US37045XBPO6 | 2,350 % General Motors Financial Co. Inc. v.16(2019) | 0 | 1.000.000 |
| US685218AC36 | 1,625 % Orange S.A. v.16(2019) | 0 | 2.500.000 |
| USG87621AL52 | 6,150 % Tesco Plc. Reg.S. v.07(2037) | 0 | 232.000 |
| US913017CF48 | 1,500 % United Technologies Corporation v.16(2019) | 0 | 3.000.000 |
| US912828F395 | 1,750 % Vereinigte Staaten von Amerika v.14(2019) | 0 | 9.000.000 |
| US9128282V18 | 1,375 % Vereinigte Staaten von Amerika v.17(2020) | 0 | 5.000.000 |
| Neuemissionen, die zum Börsenhandel vorgesehen sind | | | |
| EUR | | | |
| XS2102489353 | 2,250 % Altice Financing S.A. Reg.S. v.20(2025) | 900.000 | 900.000 |
| XS2102493389 | 3,000 % Altice Financing S.A. Reg.S. v.20(2028) | 1.500.000 | 1.500.000 |
| XS2066744231 | 1,000 % Carnival Plc. v.19(2029) | 3.200.000 | 3.200.000 |
| XS2065946837 | 1,000 % ENI S.p.A. EMTN Reg.S. v.19(2034) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| FR0013463676 | 0,000 % EssilorLuxottica S.A. Reg.S. v.19(2031) | 600.000 | 600.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UnInstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|--------------|---|-----------|-----------|
| XS2109608724 | 1,250 % Fastighets AB Balder EMTN Reg.S. v.20(2028) | 900.000 | 900.000 |
| XS2109806369 | 0,250 % FCA Bank S.p.A. [Irish Branch] EMTN Reg.S. v.20(2023) | 900.000 | 900.000 |
| XS2036798150 | 2,250 % IQVIA Inc. Reg.S. v.19(2028) | 1.000.000 | 2.000.000 |
| XS2089229806 | 0,000 % Merlin Properties SOCIMI S.A. Reg.S. v.19(2034) | 3.200.000 | 3.200.000 |
| XS2060691040 | 0,000 % NV Nederlandse Gasunie EMTN Reg.S. v.19(2031) | 0 | 1.100.000 |
| XS2102283814 | 0,050 % Santander UK Plc. Reg.S. Pfe. v.20(2027) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| XS2075811781 | 0,875 % Ses S.A. EMTN Reg.S. v.19(2027) | 1.500.000 | 1.500.000 |
| XS2067265392 | 9,250 % Summer [BC] Holdco A S.a.r.l. Reg.S. v.19(2027) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| XS1982819994 | 2,750 % Telecom Italia S.p.A. EMTN Reg.S. v.19(2025) | 0 | 1.000.000 |
| XS2122485845 | 0,500 % The Dow Chemical Co. v.20(2027) | 1.400.000 | 1.400.000 |
| XS2122486066 | 1,125 % The Dow Chemical Co. v.20(2032) | 1.300.000 | 1.300.000 |

An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere

EUR

| | | | |
|--------------|--|-----------|-----------|
| XS2083147343 | 1,625 % Albemarle New Holding GmbH Reg.S. v.19(2028) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| XS2110799751 | 2,125 % Altice France S.A. Reg.S. v.20(2025) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| XS1992154341 | 8,000 % Altice Luxembourg S.A. Reg.S. v.19(2027) | 0 | 1.500.000 |
| XS2010032378 | 0,250 % ASML Holding NV Reg.S. v.20(2030) | 2.500.000 | 2.500.000 |
| XS2037757684 | 5,125 % ASR Media and Sponsorship S.p.A. Reg.S. v.19(2024) | 0 | 600.000 |
| XS1468538035 | 4,250 % Axalta Coating Systems LLC Reg.S. v.16(2024) | 0 | 100.000 |
| XS2080317832 | 0,875 % Ball Corporation v.19(2024) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| DE000A2YNQW7 | 4,500 % Bilfinger SE Reg.S. v.19(2024) | 0 | 1.700.000 |
| XS1703065620 | 5,250 % CMA CGM S.A. Reg.S. v.17(2025) | 0 | 500.000 |
| XS1843437465 | 9,625 % Conus Real Estate AG Reg.S. v.19(2024) | 0 | 2.000.000 |
| XS2117462627 | 0,000 % Dte. Bahn Finance GmbH EMTN Reg.S. v.20(2024) | 1.200.000 | 1.200.000 |
| XS1266592457 | 4,500 % Dufry Fin S.C.A. Reg.S. v.15(2019) | 0 | 4.100.000 |
| XS1883354976 | 4,750 % Fire [BC] S.p.A. Reg.S. FRN v.18(2024) | 0 | 700.000 |
| XS1684387456 | 2,875 % IQVIA Inc. Reg.S. v.17(2025) | 0 | 1.000.000 |
| XS1881005976 | 4,500 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. Reg.S. v.18(2026) | 0 | 2.000.000 |
| XS1605600532 | 4,000 % La Financiere Atalian S.A. Reg.S. v.17(2024) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| DE000LB2CQG8 | 0,010 % Landesbank Baden-Württemberg Reg.S. Pfe. v.20(2027) | 700.000 | 700.000 |
| XS1975699569 | 2,875 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 2.000.000 |
| XS1975716595 | 4,500 % Loxam S.A.S. Reg.S. v.19(2027) | 0 | 1.400.000 |
| XS2056374353 | 0,875 % Mondelez International Holdings Netherlands BV Reg.S. v.19(2031) | 0 | 2.400.000 |
| XS1690645129 | 5,000 % Nidda BondCo GmbH Reg.S. v.17(2025) | 0 | 1.000.000 |
| XS2114009603 | 3,500 % Nidda Healthcare Holding GmbH Reg.S. v.17(2024) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS2082471587 | 3,500 % Nidda Healthcare Holding GmbH Reg.S. v.19(2024) | 7.300.000 | 7.300.000 |
| XS1577963058 | 4,500 % Norican A/S Reg.S. v.17(2023) | 0 | 339.000 |
| XS1818737287 | 8,000 % Odyssey Europe Holdco S.à r.l. Reg.S. v.18(2023) | 0 | 1.750.000 |
| XS0542593792 | 6,750 % Ol European Group BV EMTN v.10(2020) | 0 | 750.000 |
| XS2064302735 | 0,875 % PepsiCo Inc. v.19(2039) | 2.400.000 | 2.400.000 |
| XS2010039118 | 5,875 % Quatrim S.A.S. Reg.S. v.19(2024) | 1.600.000 | 1.600.000 |
| XS1958300375 | 2,750 % Rexel S.A. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 1.900.000 |
| XS2109812508 | 2,000 % Rumänien Reg.S. v.20(2032) | 800.000 | 800.000 |
| XS2109813142 | 3,375 % Rumänien Reg.S. v.20(2050) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| XS1756359045 | 5,375 % Selecta Group BV Reg.S. FRN v.18(2024) | 0 | 1.000.000 |
| XS1945271952 | 4,625 % SGL CARBON SE Reg.S. v.19(2024) | 0 | 600.000 |
| XS1074396927 | 3,250 % Smurfit Kappa Acquisitions Unlimited Co. Reg.S. v.14(2021) | 0 | 2.000.000 |
| XS1849518276 | 2,875 % Smurfit Kappa Acquisitions Unlimited Co. Reg.S. v.18(2026) | 0 | 3.400.000 |
| XS2050968333 | 1,500 % Smurfit Kappa Treasury PUC Reg.S. v.19(2027) | 0 | 1.300.000 |
| XS2059866934 | 2,250 % SNCF Réseau v.17(2047) | 0 | 2.000.000 |
| XS1990733898 | 6,250 % Tasty Bondco 1 S.A.U. Reg.S. v.19(2026) | 0 | 1.200.000 |
| XS2083962691 | 6,000 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV Reg.S. v.19(2025) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| XS1813724603 | 4,500 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV v.18(2025) | 0 | 2.800.000 |
| XS1908250191 | 3,500 % Verisure Holding AB Reg.S. v.18(2023) | 0 | 1.600.000 |
| DE000A2AA0W5 | 3,750 % Wepa Hygieneprodukte GmbH Reg.S. v.16(2019) | 0 | 4.200.000 |
| XS2054209320 | 0,452 % Wintershall Dea Finance BV Reg.S. v.19(2023) | 0 | 1.600.000 |
| XS2054209833 | 0,840 % Wintershall Dea Finance BV Reg.S. v.19(2025) | 0 | 3.400.000 |
| XS2055079904 | 1,823 % Wintershall Dea Finance BV Reg.S. v.19(2031) | 0 | 1.500.000 |
| XS2069016165 | 2,875 % Ziggo BV Reg.S. v.19(2030) | 2.400.000 | 2.400.000 |

USD

| | | | |
|--------------|---|-----------|-----------|
| US031162CU27 | 2,450 % Amgen Inc. v.20(2030) | 1.300.000 | 1.300.000 |
| US058498AU01 | 4,375 % Ball Corporation v.15(2020) | 2.000.000 | 6.000.000 |
| USG5002FAE63 | 3,500 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. Reg.S. v.15(2020) | 0 | 1.650.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

UniInstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|--------------|--|-----------|-----------|
| US47010BAE48 | 3,500 % Jaguar Land Rover Automotive Plc. 144A v.15(2020) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| US47010BAD64 | 4,250 % Jaguar Land Rover Automotive Plc.144A v.14(2019) | 0 | 5.450.000 |
| US64110LAE65 | 5,375 % Netflix Inc. v.13(2021) | 2.745.000 | 2.745.000 |
| USN8540WAC84 | 7,125 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV Reg.S. v.19(2025) | 200.000 | 200.000 |
| US88167AAL52 | 6,000 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV v.18(2024) | 0 | 200.000 |
| US88167AAK79 | 6,750 % Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV v.18(2028) | 0 | 200.000 |

Neuemissionen, die zum Handel an einem organisierten Markt vorgesehen sind

EUR

| | | | |
|--------------|--|-----------|-----------|
| XS2083146964 | 1,125 % Albemarle New Holding GmbH Reg.S. v.19(2025) | 1.800.000 | 1.800.000 |
|--------------|--|-----------|-----------|

Nicht notierte Wertpapiere

EUR

| | | | |
|--------------|-----------------------------|-----------|-----------|
| RO1621DBE048 | 1,250 % Rumänien v.16(2021) | 3.000.000 | 3.000.000 |
|--------------|-----------------------------|-----------|-----------|

Investmentfondsanteile 1)

Luxemburg

| | | | |
|--------------|----------------------|---|-----|
| LU0201780276 | UniReserve: Euro -M- | 0 | 200 |
|--------------|----------------------|---|-----|

Optionen

EUR

| | | |
|---|------------|------------|
| Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/2,750 | 10.000.000 | 0 |
| Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/2,125 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/2,250 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Call on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/2,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Dezember 2019/2,375 | 10.000.000 | 0 |
| Call on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/2,750 | 10.000.000 | 0 |
| Call on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Dezember 2019/2,375 | 10.000.000 | 0 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/2,750 | 10.000.000 | 0 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/2,125 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/2,250 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 40.000.000 | 40.000.000 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/2,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/2,125 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Call on Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/2,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Call on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/2,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Call on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/3,000 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Dezember 2019/3,250 | 30.000.000 | 0 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,125 | 50.000.000 | 50.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,500 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/3,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/2,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/3,000 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Put on Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/3,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on Barclays Bank Plc., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/3,250 | 10.000.000 | 0 |
| Put on Barclays Bank Plc., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/3,500 | 10.000.000 | 0 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/2,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Dezember 2019/2,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Dezember 2019/3,250 | 30.000.000 | 0 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,125 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,375 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,500 | 50.000.000 | 50.000.000 |
| Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,000 | 40.000.000 | 40.000.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|------|--|------------|------------|
| | Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,375 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,750 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Dezember 2019/3,500 | 0 | 20.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/3,250 | 10.000.000 | 0 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,125 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,000 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,375 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/3,500 | 30.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS November 2019/2,500 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Dezember 2019/3,500 | 0 | 20.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS April 2020/3,000 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,125 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,375 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/4,000 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Juni 2020/3,750 | 60.000.000 | 60.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Juni 2020/4,000 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/3,000 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/3,250 | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/3,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/3,000 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on Dte. Bank AG, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/3,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on EUX 10YR Euro-Bund Future November 2019/170,00 | 200 | 200 |
| | Put on Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Februar 2020/3,125 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on Goldman Sachs International, London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Mai 2020/3,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS Oktober 2019/3,500 | 10.000.000 | 0 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Dezember 2019/2,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,250 | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,375 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS Januar 2020/2,500 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS März 2020/3,250 | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Put on J.P. Morgan Securities Plc., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS November 2019/2,500 | 20.000.000 | 20.000.000 |

Terminkontrakte

EUR

| | | |
|--|-------|-------|
| EUX 10YR Euro-BTP 6% Future Dezember 2019 | 80 | 20 |
| EUX 10YR Euro-BTP 6% Future Juni 2020 | 37 | 37 |
| EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2019 | 1.080 | 1.010 |
| EUX 10YR Euro-Bund Future Dezember 2019 | 10 | 10 |
| EUX 10YR Euro-Bund Future Juni 2020 | 160 | 160 |
| EUX 10YR Euro-Bund Future März 2020 | 2.420 | 2.420 |
| EUX 10YR Euro-Bund Future März 2020 | 860 | 860 |
| EUX 30YR Bundesanleihe 4% Future Juni 2020 | 70 | 70 |
| 10YR Euro-BTP 6% Future März 2020 | 160 | 160 |

Credit Default Swaps

EUR

| | | |
|---|------------|------------|
| Bank of America Merrill Lynch International Ltd., London/TUI AG CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S31 5Yr Index CDS v.19(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 60.000.000 | 60.000.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|------|---|-------------|-------------|
| | Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.19(2020) | 50.000.000 | 50.000.000 |
| | Barclays Bank Ireland Plc., Dublin/iTraxx Europe Xover S22 5 Yr Index CDS v.19(2019) | 0 | 10.000.000 |
| | Barclays Bank Ireland Plc./HeidelbergCement AG CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 |
| | Barclays Bank Plc./Casino Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 0 |
| | Barclays Bank Plc./Casino Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 0 |
| | Barclays Bank Plc./HeidelbergCement AG v.09(2019) CDS v.18(2023) | 0 | 5.000.000 |
| | Barclays Bank Plc./Imperial Brands Finance Plc. CDS v.18(2023) | 5.000.000 | 0 |
| | Barclays Bank Plc./Techem GmbH CDS v.16(2020) | 1.000.000 | 0 |
| | Barclays Bank Plc./thyssenkrupp AG CDS v.18(2023) | 2.000.000 | 0 |
| | Barclays Bank Plc./Wendel S.A. CDS v.18(2023) | 0 | 2.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/ENEL S.p.A. CDS v.19(2024) | 0 | 3.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Imperial Brands Finance Plc. CDS v.20(2023) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 20.000.000 | 0 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 10.000.000 | 0 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 30.000.000 | 30.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Crossover S33 5Yr Index CDS v.20(2025) | 10.000.000 | 10.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S22 5Yr Index CDS v.19(2019) | 0 | 50.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.19(2020) | 60.000.000 | 60.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.19(2020) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 100.000.000 | 100.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S23 5Yr Index CDS v.20(2020) | 50.000.000 | 50.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 15.000.000 | 15.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe S32 5Yr Index CDS v.20(2024) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Xover S23 5 Yr Index CDS v.19(2020) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/iTraxx Europe Xover S23 5 Yr Index CDS v.20(2020) | 20.000.000 | 20.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/LafargeHolcim Ltd. CDS v.18(2023) | 0 | 5.000.000 |
| | BNP Paribas S.A., Paris/Wendel SE CDS v.19(2023) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | Citibank Europe Plc., Dublin/Neos Group Holdings S.A. CDS v.20(2024) | 3.000.000 | 3.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/ BAT International Finance Plc. CDS v.19(2024) | 5.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.18(2023) | 1.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/Casino, Guichard-Perrachon S.A. CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover Serie 25 Index (5 Years) CDS v.19(2021) | 0 | 10.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/iTraxx Europe Crossover S32 5Yr Index CDS v.19(2024) | 5.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/TUI AG CDS v.19(2024) | 2.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd., London/Wendel SE CDS v.18(2023) | 0 | 5.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./BMW Finance NV CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./LafargeHolcim Ltd. CDS v.18(2023) | 0 | 5.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Leonardo S.p.A. CDS v.19(2024) | 0 | 4.000.000 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./TUI AG CDS v.19(2024) | 2.000.000 | 0 |
| | Citigroup Global Markets Ltd./Volkswagen International Finance NV Reg.S. CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 |
| | Credit Suisse International, London/Enel S.p.A. CDS v.19(2023) | 0 | 5.000.000 |
| | Credit Suisse International, London/Fiat Chrysler Automobiles NV CDS v.19(2024) | 0 | 5.000.000 |
| | Credit Suisse International, London/Peugeot S.A. CDS v.20(2024) | 5.000.000 | 5.000.000 |
| | Credit Suisse International, London/TUI AG CDS v.19(2024) | 3.000.000 | 0 |
| | Credit Suisse International, London/TUI AG CDS v.19(2024) | 3.000.000 | 0 |
| | Credit Suisse International, London/TUI AG CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 1.000.000 |
| | Credit Suisse International, London/TUI AG CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 1.000.000 |

Die Erläuterungen sind integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Uninstitutional Global High Yield Bonds

| ISIN | Wertpapiere | Zugänge | Abgänge |
|------------|--|-----------|-----------|
| USD | | | |
| | BNP Paribas S.A., Paris/General Electric Co. CDS v.19(2024) | 2.000.000 | 2.000.000 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./General Electric Co. CDS v.19(2024) | 3.000.000 | 0 |
| | Goldman Sachs AG, Frankfurt a.M./Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.19(2024) | 1.000.000 | 0 |
| | Goldman Sachs International., London/Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.18(2023) | 2.000.000 | 0 |
| | J.P. Morgan Securities Plc., London/Teva Pharmaceutical Finance Co. BV CDS v.18(2023) | 1.000.000 | 0 |

- 1) Angaben zu Ausgabeaufschlägen, Rücknahmeabschlägen sowie zur maximalen Höhe der Verwaltungsgebühr für Zielfondsanteile sind auf Anfrage am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, bei der Verwahrstelle und bei den Zahlstellen kostenlos erhältlich. Von gehaltenen Anteilen eines Zielfonds, die unmittelbar oder aufgrund einer Übertragung von derselben Verwaltungsgesellschaft oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der die Verwaltungsgesellschaft durch eine gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist, wird keine oder eine reduzierte Verwaltungsvergütung berechnet.