

JAHRESBERICHT UND GEPRÜFTER ABSCHLUSS  
SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE  
31. MÄRZ 2022

## THREADNEEDLE (LUX)

## Inhalt

<b>Informationen zur Gesellschaft</b>	<b>4</b>	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	<b>76</b>
<b>Bericht der Geschäftsleitung</b>	<b>5</b>	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	<b>77</b>
<b>Wertentwicklung</b>	<b>8</b>	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	<b>78</b>
<b>Bericht des Abschlussprüfers</b>	<b>9</b>	<b>Portfolioaufstellungen</b>	
<b>Abschluss:</b>		Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>80</b>
Konsolidierter Abschluss für Threadneedle (Lux)	<b>12</b>	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>88</b>
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	<b>13</b>	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>94</b>
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	<b>15</b>	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>102</b>
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	<b>17</b>	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>108</b>
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	<b>19</b>	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>117</b>
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	<b>20</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>125</b>
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	<b>22</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>130</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	<b>23</b>	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>136</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	<b>25</b>	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>140</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	<b>26</b>	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>151</b>
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	<b>27</b>	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>155</b>
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	<b>29</b>	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	<b>157</b>
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	<b>30</b>	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	<b>160</b>
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	<b>31</b>	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	<b>176</b>
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	<b>32</b>	Threadneedle (Lux) - Global Focus	<b>178</b>
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	<b>34</b>	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	<b>180</b>
Threadneedle (Lux) - Global Focus	<b>35</b>	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	<b>183</b>
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	<b>37</b>	Threadneedle (Lux) - Global Select	<b>185</b>
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	<b>38</b>	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	<b>187</b>
Threadneedle (Lux) - Global Select	<b>40</b>	Threadneedle (Lux) - American	<b>189</b>
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	<b>41</b>	Threadneedle (Lux) - American Select	<b>190</b>
Threadneedle (Lux) - American	<b>43</b>	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	<b>191</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	<b>45</b>	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	<b>193</b>
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	<b>47</b>	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	<b>195</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	<b>48</b>	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	<b>197</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	<b>49</b>	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	<b>199</b>
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	<b>50</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	<b>200</b>
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	<b>51</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	<b>202</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	<b>53</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	<b>204</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	<b>55</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	<b>206</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	<b>57</b>	Threadneedle (Lux) - European Select	<b>208</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	<b>58</b>	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	<b>210</b>
Threadneedle (Lux) - European Select	<b>60</b>	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	<b>212</b>
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	<b>62</b>	Threadneedle (Lux) - Global Technology	<b>214</b>
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	<b>63</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equities	<b>216</b>
Threadneedle (Lux) - Global Technology	<b>64</b>	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	<b>217</b>
Threadneedle (Lux) - UK Equities	<b>65</b>	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	<b>218</b>
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	<b>67</b>	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	<b>219</b>
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	<b>69</b>	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	<b>226</b>
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	<b>70</b>	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	<b>231</b>
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	<b>71</b>	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	<b>232</b>
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	<b>73</b>	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	<b>233</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	<b>75</b>	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	<b>235</b>

\*Siehe Erläuterung 1.

## Inhalt

(Fortsetzung)

<b>Erläuterungen zum Abschluss</b>	<b>236</b>
<b>Gesamtrisiko (ungeprüft)</b>	<b>356</b>
<b>Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)</b>	<b>358</b>
<b>Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)</b>	<b>361</b>
<b>Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)</b>	<b>362</b>
<b>Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)</b>	<b>394</b>
<b>Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)</b>	<b>396</b>
<b>Adressverzeichnis</b>	<b>405</b>

Zeichnungen werden nicht auf der Grundlage der Finanzberichte entgegengenommen. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des Verkaufsprospekts in Verbindung mit dem letzten Jahresbericht und dem letzten Halbjahresbericht, falls dieser nach dem Jahresbericht veröffentlicht wurde, erfolgen.

Bei diesem Bericht handelt es sich um eine Übersetzung der englischen Originalversion. Bei etwaigen Unklarheiten hat die englische Sprachversion Vorrang, soweit nach anwendbarem Recht zulässig.

## Informationen zur Gesellschaft

### Gesellschaft

Threadneedle (Lux)  
R.C.S. Luxemburg B-50.216

### Eingetragener Firmensitz

31 Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### Verwaltungsrat

Jonathan Allen (am 7. Mai 2021 als Verwaltungsratsmitglied zurückgetreten)  
Head of Asia Pacific Institutional Sales and Product Development  
Columbia Threadneedle Investments  
Singapur

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini (am 7. Mai 2021 als  
Verwaltungsratsmitglied zurückgetreten)  
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Claude Kremer  
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Julie Griffiths  
Chief Risk Officer, EMEA und Global Head of Investment Risk  
Columbia Threadneedle Investments  
London  
Vereinigtes Königreich

Annemarie Nicole Arens (am 7. Mai 2021 in den Verwaltungsrat berufen)  
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Joseph Patrick LaRocque (am 7. Mai 2021 in den Verwaltungsrat berufen)  
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied  
Maryland  
Vereinigte Staaten von Amerika

Thomas Seale (am 7. Mai 2021 in den Verwaltungsrat berufen)  
Unabhängiges, nicht geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied  
Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

## Bericht der Geschäftsleitung

Für die Aktienmärkte der meisten Industrieländer war das Berichtsjahr eine turbulente, aber positive Phase, während die Aktien- und Rentenmärkte der Schwellenländer (EM) negative Renditen hinnehmen mussten. Rohstoffe verbuchten kräftige Zugewinne, wobei insbesondere die Öl- und Gaspreise stark anstiegen. Hauptauslöser dieser Bewegungen war generell eine kräftige, durch Impfstoffe angestoßene Erholung der Weltwirtschaft, die durch zusätzliche staatliche Konjunkturmaßnahmen – vor allem in den USA – unterstützt wurde. Die Anleger zeigten sich jedoch zunehmend besorgt, als die Inflation in weiten Teilen der Welt rapide in die Höhe schnellte. Dies belastete die Rentenmärkte, da die Anleger höhere Zinssätze erwarteten. Unter den großen Industrieländern war die Bank of England (BoE) die erste, die ihre Zinsen im Dezember anhob, während die US-Notenbank (Fed) ihre erste Erhöhung im März ankündigte. Die negative Stimmung gegenüber Risikoanlagen wurde durch die erhöhte geopolitische Unsicherheit verstärkt, als Russland Ende Februar in die Ukraine einmarschierte.

Im Frühjahr und den ersten Sommermonaten des Jahres 2021 tendierten die Aktienmärkte aufwärts. Die Stimmung in Bezug auf Risikoanlagen wurde durch die von Impfstoffen ausgelöste Erholung der weltweiten Wirtschaftstätigkeit sowie durch gute Unternehmensgewinne und die Hoffnung auf weitere Konjunkturmaßnahmen der US-Regierung gestützt. Die Märkte für Unternehmensanleihen profitierten zudem davon, dass das Neuemissionsvolumen im Vergleich zu 2020 niedriger ausfiel. Die Sorgen über die Bewertungen blieben jedoch bestehen, da die Renditen und die Spreads gegenüber Staatsanleihen im historischen Vergleich sehr niedrig waren. Obwohl der weltweite Konjunkturaufschwung unerwartet hohe Inflationsraten mit sich brachte, tendierten die Renditen auf Staatsanleihen der Kernländer während des Berichtszeitraums größtenteils abwärts, da die großen Zentralbanken den Preisdruck anfänglich als vorübergehendes Phänomen abtaten, das mit dem Abklingen der pandemiebedingten Probleme nachlassen würde.

Im Spätsommer und Herbst schlugen sich Lieferketten- und Personalengpässe zunehmend in einer Abkühlung der Wachstumsdaten nieder. Nichtsdestotrotz legten Aktien weiter zu, während sich die Renditespannen für Investment-Grade-Unternehmensanleihen (IG) kaum veränderten. Die Renditen auf Staatsanleihen der Kernländer stiegen, da zunehmend der Eindruck aufkam, dass die politischen Entscheidungsträger die Inflationsgefahr unterschätzt haben könnten.

Im letzten Quartal 2021 schwenkten die Fed, die BoE und (in geringerem Maße) auch die Europäische Zentralbank (EZB) jeweils auf eine restriktivere Geldpolitik um und signalisierten endlich, dass die Notwendigkeit einer effektiven Inflationskontrolle etwaige Wachstumsrisiken aufgrund einer strafferen Geldpolitik und der (zu diesem Zeitpunkt) neu entdeckten Omikron-Variante des Coronavirus überwog. Nachdem die Fed bereits begonnen hatte, ihr Wertpapierkaufprogramm zu drosseln, überraschte sie die Anleger im Dezember, als sie mehrere Zinserhöhungen im Laufe des Jahres 2022 in Aussicht stellte. Bis dahin hatte sie lediglich einen einzigen Zinsschritt angedeutet. Unterdessen erhöhte im Vereinigten Königreich die BoE ihre Zinsen im Dezember erstmalig seit drei Jahren. Die EZB bewegte sich ebenfalls auf eine Normalisierung ihrer Geldpolitik zu, schien jedoch hinter ihren Pendant aus den USA und dem Vereinigten Königreich zurückzubleiben: Sie wählte einen weicheren Ansatz für die Drosselung ihrer Konjunkturprogramme als die Fed und ließ durchblicken, dass erst 2023 mit Zinserhöhungen zu rechnen sein dürfte.

Die Anleiherenditen tendierten Anfang 2022 weiter aufwärts, da sich die Anzeichen verdichteten, dass die Omikron-Variante weniger aggressiv sein dürfte als ihre Vorgänger. Zudem ließ das Protokoll der Dezembersitzung der US-Notenbank erkennen, dass die dort vorherrschende Konsensmeinung deutlich restriktiver war als von vielen Kommentatoren erwartet. Dies erwies sich für Aktien und Unternehmensanleihen als ungünstig. An den Aktienmärkten waren es vor allem Wachstumswerte, die stark abverkauft wurden, da allgemein angenommen wird, dass diese anfälliger auf Zinserhöhungen reagieren.

Im weiteren Verlauf des ersten Quartals 2022 rückte die Geopolitik in den Mittelpunkt, als Russland Truppen und Ausrüstung an seiner Grenze zur Ukraine zusammenzog und schließlich eine vollständige Invasion des Landes einleitete. Die Volatilität stieg stark an, Aktien wurden abverkauft und die Renditespannen von Unternehmensanleihen erweiterten sich deutlich. Die Rohstoffpreise stiegen stark an, da in Verbindung mit der Krise und den vom Westen gegen Moskau verhängten Sanktionen Versorgungsunterbrechungen erwartet wurden. Angesichts der erhöhten Risikoscheu machten Staatsanleihen der Kernländer einen Teil ihrer zuvor erlittenen Verluste wieder wett. Allerdings fiel die Rally gemäßigt aus, da Befürchtungen aufkamen, dass der Konflikt die Inflation weiter in die Höhe treiben würde.

In der Tat nahm die Fed in der Folge Kurs auf eine Normalisierung ihrer Geldpolitik, indem sie die Zinsen im März um 0,25 % anhob. Dies war die erste Zinserhöhung der Notenbank seit 2018. Unterdessen hob die BoE ihre Zinsen im Februar und März jeweils um 0,25 % an, wodurch der Leitzins auf das vor der Pandemie vorherrschende Niveau zurückkehrte. Da die Inflation im Euroraum auf ein Rekordhoch stieg, äußerte sich auch die EZB in ihren Kommentaren zunehmend restriktiv, wobei die politischen Entscheidungsträger von ihrer vorherigen Andeutung, dass eine Zinsanhebung im Jahr 2022 unwahrscheinlich sei, Abstand nahmen.

Der MSCI ACWI Index erzielte während des Jahres in Lokalwährung eine Rendite von 9,2 %. Auf regionaler Ebene wurden die stärksten Renditen über weite Strecken des Jahres 2021 hinweg in den USA erzielt, da der Markt von Optimismus in Verbindung mit den staatlichen Konjunkturmaßnahmen sowie von starken Unternehmensgewinnen profitierte. Das Vereinigte Königreich entwickelte sich ebenfalls überdurchschnittlich, da die an diesem Markt stark vertretenen Energie- und Bergbausektoren vom rasanten Anstieg der Rohstoffpreise im letzten Quartal des Berichtszeitraums profitierten. Aktien aus Europa außerhalb des Vereinigten Königreichs fielen zurück, da die Region stark auf Energieimporte aus Russland angewiesen daher anfällig für die gegen Moskau verhängten Sanktionen ist. Die Schwellenländer bildeten die Schlusslichter und verbuchten im Berichtszeitraum negative Renditen. Belastet wurden sie insbesondere durch das Index-Schwergewicht China, wo Aktien unter einem weitreichenden harten Durchgreifen der Aufsichtsbehörden litten. Rohstoffexportländer wie Brasilien und Südafrika hingegen verbuchten robuste Zugewinne.

Alles in allem war dies für die Märkte der Staatsanleihen der Kernländer ein schwieriger Zeitraum. Insgesamt legten die Renditen auf die als Benchmark geltenden zehnjährigen US-Staatsanleihen im Jahresverlauf um 0,60 % zu. Demgegenüber verzeichneten entsprechende britische Gilts und deutsche Bundesanleihen einen Anstieg um jeweils 0,77 % bzw. 0,84 %.

Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating (IG) mussten während des Berichtszeitraums ebenfalls negative Renditen hinnehmen. Über weite Strecken des Jahres 2021 hinweg blieben die Spreads von IG-Anleihen relativ stabil. Im November löste dann jedoch der von der Ausbreitung der Omikron-Variante angestoßene Abverkauf eine deutliche Erweiterung aus. 2022 setzte sich die Erweiterungstendenz bei den Spreads fort, da die Märkte eine schnellere geldpolitische Straffung einpreisten, während der Einmarsch Russlands in die Ukraine Sorgen über höhere Rohstoffpreise und den Wachstumsausblick aufkommen ließ. Insgesamt erweiterten sich die Spreads globaler IG-Anleihen während des Berichtsjahres um 0,27 %. Die Spreads auf europäische

## Bericht der Geschäftsleitung

(Fortsetzung)

Hochzinsanleihen (HY) erweiterten sich deutlich, während bei ihren Pendants aus den USA während des Berichtszeitraums nur eine moderate Erweiterung verzeichnet wurde, da dieser Markt weniger stark vom Abverkauf des Jahres 2022 betroffen war.

Im Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity Fund beteiligten wir uns am Börsengang von LG Energy Solution, einem weltweit führenden Anbieter von Lithium-Ionen-Batterien, die beim Übergang zu grüner Energie eine zentrale Rolle spielen. Die Aktie entwickelte sich besonders gut, und wir verkauften sie in der Folge mit Gewinn. Außerdem nahmen wir am Börsengang des Digital Core Real Estate Investment Trust teil, der Rechenzentren weltweit besitzt und verwaltet und ein gutes Anlageportfolio aufweist. Zu den übrigen neuen Positionen zählten Santos, BOC Hong Kong, Meituan und Transurban. Die Stärke des Ölpreises hat sich positiv auf das australische Energieunternehmen Santos ausgewirkt, während die Bankengruppe BOC Hong Kong von der Erholung der Wirtschaftstätigkeit und den höheren Zinsen profitiert. Die chinesische Internet-Einkaufsplattform Meituan ermöglicht derzeit ein Engagement im Wachstum des inländischen Konsums. Der australische Mautstraßenbetreiber Transurban verfügt über attraktive Aktiva, und der Straßenverkehr erholt sich im Nachgang der Pandemie. Angesichts von Sorgen über die möglichen Auswirkungen einer schnelleren Normalisierung der Geldpolitik auf hoch bewertete Technologietitel haben wir unser Engagement im Technologiesektor in den letzten Monaten verringert. Wir trennten uns von ASM Pacific Technology sowie von MediaTek und vom chinesischen Hersteller von Elektrofahrzeugen XPeng.

Im Threadneedle (Lux) - American Select Fund nahm die Fondsaktivität im Sommer 2021 zu, da das Portfolio umgestaltet wurde, um die bevorzugte Positionierung des neuen leitenden Fondsmanagers abzubilden. Zu den neuen Positionen dieses Fonds zählten Northern Trust, United Parcel Service (UPS) und Salesforce. Die Privatbank Northern Trust verzeichnet ein stetiges Umsatzwachstum und eine gute operative Leverage und profitiert von steigenden Zinsen im Verwahrgeschäft, insbesondere am vorderen Ende der Renditekurve. Dem Paketzusteller UPS gelingt es, seine Volumina zu steigern, da sich der Einzelhandel immer weiter ins Internet verlagert und die Komplexität der Lieferketten zunimmt. Da der US-Postdienst allmählich an seine Kapazitätsgrenzen stößt, bieten die neuerliche Belebung der margenstarken Business-to-Business-Dienste und das Kundenwachstum bei kleinen und mittleren Unternehmen zusätzliche Unterstützung. Salesforce stellt Automatisierungssoftware her, die eine entscheidende Komponente für Digital-Experience-Plattformen darstellt. Das Unternehmen hält nach wie vor eine dominante Position (Marktanteil von 40 %) im Bereich der Vertriebsautomatisierung, hat aber im Laufe der Zeit seine Produktpalette um die Bereiche Handel, Marketing und Kundensupport erweitert, die es zu gegebener Zeit als Teil einer einzigen nahtlosen Plattform anbieten möchte. Zu den aufgelösten Positionen zählten Amazon, Visa, PayPal, Bank of America und Intuit. Northern Trust, UPS und Salesforce zählten auch zu den neuen Beteiligungen des Threadneedle (Lux) - American Fund, wo im Gegenzug Positionen in Amazon, Charles River Laboratories, Morgan Stanley, BlackRock und Comcast glattgestellt wurden.

Im Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies Fund beteiligten wir uns an Axos Financial, Cirrus Logic und Madison Square Garden Entertainment. Axos Financial betreibt die Axos Bank, eine kleine digitale Direkt- und Online-Bank mit nationalem Ansatz. Die Bank profitiert dank ihres Engagements in privaten Hypothekendarlehen von einer hohen Wachstumsrate ihrer Bilanz und ihres Kreditbestands. Außerdem weist sie dank ihres Geschäftsmixes und ihrer inhärent niedrigeren Kosten höhere Margen auf als ihre Wettbewerber. Cirrus ist ein Entwickler von Halbleiterlösungen und ein wichtiger Lieferant für viele Technologieunternehmen. Das Unternehmen hat bei der Diversifizierung seiner Einnahmequellen weg von seinem größten Kunden (Apple) große Fortschritte gemacht, indem es seine technologische Führungsrolle bei neuen Produktgruppen und Anwendungen außerhalb des Smartphone-Segments ausgebaut hat. Damit profitiert es nun stärker vom Trend der zunehmenden Verbreitung von Inhalten. Madison Square Garden Entertainment umfasst eine Reihe erstklassiger Immobilien- und Unterhaltungsobjekte sowie eine Sport- und Unterhaltungsfernsehsparte. Die Wiederaufnahme von Live-Veranstaltungen und die Eröffnung eines neuen Veranstaltungsortes in Las Vegas (derzeit für 2023 geplant) bieten der Aktie Auftrieb. Zu den verkauften Positionen zählten KBR, Under Armour, SunPower, Novavax, Renewable Energy Group und Impinj.

Im Threadneedle (Lux) - UK Equities Fund wurden während des Berichtszeitraums neue Positionen in Tate & Lyle, Experian und ConvaTec eingerichtet. Tate & Lyle ist ein qualitativ hochwertiges Unternehmen, das zu einer attraktiven Bewertung gehandelt wird. Es achtet stark auf ein effektives Kostenmanagement, konzentriert sich auf Innovationen und setzt bei der Verbesserung seiner technischen Kompetenzen durch Übernahmen auf einen selektiven Ansatz. Experian ist ein Marktführer in den Bereichen Bonitätsprüfung, Identitätsprüfung und Betrugsbekämpfung. Der Direktvertriebskanal des Unternehmens bietet einen großen Vorteil in den Entwicklungsländern, wo er zu einer stärkeren finanziellen Integration beiträgt. ConvaTec ist ein globales Unternehmen mit hohem Marktanteil. Wir begrüßen den Ansatz des neuen Führungsteams, das sich auf Investitionen in das Unternehmen und eine Verbesserung des Umsatzwachstums konzentriert, was den Weg für eine Erholung der Margen ebnen sollte. Zu den verkauften Positionen zählte Spectris, nachdem sich der Titel stark entwickelt hatte und wir zu der Ansicht gelangt waren, dass sich günstigere Gelegenheiten an anderer Stelle boten. Auch von Inchcape trennten wir uns. Seit den Tiefstständen der Pandemie hat die Aktie eine starke Erholung verzeichnet. Wir hatten jedoch Sorgen hinsichtlich der Nachhaltigkeit der Gebrauchtwagenpreise, der strukturellen Veränderungen im Autohandel und der Auswirkungen von Elektrofahrzeugen auf die Rentabilität des Reparaturgeschäfts.

Im Threadneedle (Lux)-UK Equity Income Fund konzentrierten wir uns darauf, einige bestehende Positionen aufzustocken, darunter insbesondere Tesco und Direct Line. Tesco erzielt auf Basis mehrerer Kennzahlen gute Ergebnisse. Als britischer Marktführer im Online-Lebensmitteleinzelhandel wird das Unternehmen vom strukturellen Trend hin zum Online-Shopping profitieren. Außerdem nimmt Tesco unabhängigen Geschäften und Nahversorgern Marktanteile im stationären Handel ab. Wir schätzen den Lebensmitteleinzelhandel positiv ein und fühlen uns durch die Fortschritte des neuen Managementteams ermutigt. Direct Line wird zu attraktiven Bewertungen gehandelt und bietet eine hohe Dividendenrendite. Mit einer Reihe etablierter Marken verfügt das Unternehmen auch über Größen- und Diversifizierungsvorteile – Faktoren, die Gutes für die Rentabilität verheißen. Darüber hinaus sind wir der Meinung, dass die Größe des Unternehmens außerdem Markenstärke, unterschiedlichste Vertriebsbeziehungen sowie Möglichkeiten zur Kostensenkung mit sich bringt, die Direct Line weiterhin nutzen dürfte. Wir verkauften Wm Morrison mit Gewinn, als die Aktie im Vorfeld der Übernahme des Unternehmens von der Börse genommen wurde. Die Erlöse führten wir mehreren bestehenden Positionen zu.

Beim Threadneedle (Lux) Global Focus, Threadneedle (Lux) Global Select, Threadneedle (Lux) Global Extended Alpha und Threadneedle (Lux) Global Smaller Companies halten wir an unserem Schwerpunkt auf Unternehmen mit nachhaltigen Wettbewerbsvorteilen fest, da diese unserer Ansicht nach in der besten Ausgangsposition sind, um unter einer Reihe von Marktbedingungen weiterhin hohe Renditen und Ertragswachstum zu liefern. Zu den Titeln, die in einigen dieser Fonds hinzugekauft wurden, zählten Qualcomm, Apple und Kadant. Qualcomm zeichnet sich durch eine beträchtliche Größe und eine marktführende Position im Bereich der Mobilfunktechnologie der nächsten Generation aus und ist ein wichtiger Lieferant von Halbleitern für die Produkte des Technologieriesen Apple. Apple hat im vergangenen Jahr seine Innovationsstärke weiter unter Beweis gestellt und eine Reihe von Spitzenprodukten

## Bericht der Geschäftsleitung

(Fortsetzung)

auf den Markt gebracht, darunter die neueste iPhone 13-Serie, die HomePod Minis und das leistungsstärkste MacBook Pro aller Zeiten, mit dem sich das Unternehmen deutlich von der Konkurrenz abgesetzt hat. Kadant ist ein führender Anbieter von Produkten und Dienstleistungen zur Verbesserung der Prozesseffizienz, Optimierung der Energienutzung und Maximierung der Produktivität in ressourcenintensiven Industrien. Das Unternehmen ist gut aufgestellt, um vom erwarteten Anstieg der US-Infrastrukturausgaben zu profitieren. Zu den verkauften Positionen zählte unter anderem Activision Blizzard, wo wir Bedenken hinsichtlich der Corporate Governance hatten. Auch von Tencent trennten wir uns, da uns das harte Durchgreifen der chinesischen Aufsichtsbehörden im Internet- und Gaming-Sektor Sorgen bereitete.

Beim Threadneedle (Lux) Global Equity Income Fund konzentrieren wir uns auch weiterhin auf Qualitätserträge, d. h. auf Unternehmen mit hohen, steigenden und nachhaltigen Dividenden. Zu den neu eingerichteten Positionen zählten Proctor & Gamble (P&G) und Anthem. Die Marktposition von P&G wird durch seinen starken Markenwert und sein breit gefächertes Produktangebot sowie durch seine innovative Produktpipeline und seinen Marketingansatz gestützt. Der führende US-Krankenversicherer Anthem genießt unterdessen eine große Reichweite innerhalb der Branche, die dazu beiträgt, Kostenvorteile zu realisieren und die Kundenbindung zu steigern. Wir trennten uns von Allstate, da wir attraktivere Chancen an anderer Stelle sahen. Außerdem verkauften wir unsere Beteiligung an der CME Group, nachdem sich die Aktie stark entwickelt hatte.

Bei der Verwaltung des Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies Fund konzentrieren wir uns auf die Aktiauswahl auf der Grundlage makroökonomischer und thematischer Perspektiven. Bevorzugt wird in Unternehmen mit Wettbewerbsvorteilen und Preissetzungsmacht investiert, die auf robusten Marken, patentierten Verfahren, regulatorischen Hindernissen für den Marktzugang und starken Marktpositionen beruht. Zu den während des Jahres neu eingerichteten Positionen zählten Auction Technology, Fortnox und Allfunds. Auction Technology wird von der Verlagerung hin zu Online-Auktionen profitieren. Fortnox ist ein schnell wachsendes schwedisches Softwareunternehmen mit einer starken Position im Bereich Buchhaltung und Rechnungsstellung. Die Allfunds-Plattform besitzt einen beträchtlichen Marktanteil beim Vertrieb von Fonds mit offener Architektur in Europa. Hohe Eintrittsbarrieren, Größenvorteile und Netzwerkeffekte machen sie zu einem starken und profitablen Geschäftsmodell – das Unternehmen wächst weiter, organisch sowie durch Übernahmen. Zu den verkauften Positionen zählten Sartorius und Orpea. Die Aktie von Sartorius (Pharma- und Laborausüstung) hatte sich während der Pandemie stark entwickelt. Bei Orpea hat der CEO das Unternehmen verlassen, und der Pflegeheimbetreiber ist mit einer langwierigen Untersuchung zu Governance-Fragen konfrontiert.

Bei der Verwaltung des Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend Fund konzentrieren wir uns auf die Aktiauswahl auf der Grundlage makroökonomischer und thematischer Perspektiven. Wir investieren bevorzugt in qualitativ hochwertige Unternehmen mit Preissetzungsmacht, von denen nachhaltige Erträge und steigende Dividenden zu erwarten sind. Zu den Positionen, die während des Jahres neu eingerichtet wurden, zählten UPM, Saint-Gobain und ING. Kurzfristige Investitionen, u. a. in das neue Projekt in Uruguay, tragen dazu bei, das Forstunternehmen UPM zu einem der effizientesten Produzenten der Welt zu machen und sowohl Wachstum als auch Rendite zu steigern. Saint-Gobain steht unter neuer Leitung und profitiert davon, dass in Europa zahlreiche Gebäude aufgrund neuer Umweltvorschriften renoviert werden. Das Finanzinstitut ING verfügt über einen hohen Marktanteil in den Benelux-Ländern, was Größenvorteile bietet. Zudem ist das Unternehmen gut aufgestellt, um von einer Belebung des Wirtschaftswachstums zu profitieren. Vom Medizintechnikunternehmen Philips trennten wir uns aufgrund von Sorgen über Produktrückrufe.

Beim Threadneedle (Lux) - European Select Fund handelt es sich um ein überzeugungsgesteuertes Portfolio. Unser Hauptaugenmerk liegt auf der Titelauswahl. Wir wollen qualitativ hochwertige Unternehmen identifizieren, von denen aufgrund ihrer Preissetzungsmacht nachhaltige Erträge zu erwarten sind. Zu den während des Jahres neu eingerichteten Positionen zählten FinecoBank und Hermes International. Die italienische FinecoBank verfügt mit ihrer führenden Online-Plattform für den Vertrieb von Investmentfonds und anderen Finanzdienstleistungen über ein starkes Geschäftsmodell. Zudem weist sie Kostenvorteile gegenüber anderen Anbietern auf. Das Luxusgüterunternehmen Hermes International verfügt über eine starke Marke und erhebliche Preismacht. Wir stockten mehrere bestehende Positionen auf, darunter auch Nestlé. Der Schweizer Lebensmittelkonzern steht unter neuer Leitung und konzentriert sich auf die Verbesserung der Kapitalallokation sowie die Steigerung seiner Rendite und seiner Margen. Die Bilanz des Unternehmens ist robust und könnte attraktive Übernahmen ermöglichen. Wir trennten uns von Worldline. Der Online-Zahlungssektor wird zunehmend wettbewerbsintensiv, und das Unternehmen hat enttäuschend langsame Fortschritte bei der Veräußerung seines Terminalgeschäfts gemacht. Zu den übrigen verkauften Positionen zählte Philips, wo wir uns Sorgen über Produktrückrufe machten.

Mit Blick auf die Zukunft sind wir der Ansicht, dass sich der aktuelle Anstieg der Inflation als vorübergehend erweisen wird. Der starke Preisanstieg in Bereichen, in denen Engpässe und Unterbrechungen der Lieferketten fortbestehen, sollte jedoch genau im Auge behalten werden. Der Einmarsch Russlands in die Ukraine sorgt für weitere Unsicherheit, da die weltweiten Energie- und Getreidemärkte in Bezug auf sowohl Produktion als auch Transport gestört werden.

China stellt ebenfalls eine Quelle von Unsicherheit dar. Dies ist vor allem auf zwei Entwicklungen zurückzuführen: Das weiterhin harte Durchgreifen der Aufsichtsbehörden und die anhaltende Durchsetzung der Null-COVID-Politik, die die bestehenden Lieferkettenprobleme verschärft hat. Allerdings waren die damit verbundenen Auswirkungen innerhalb des Schwellenmarktuniversums größtenteils auf chinesische Anlagen beschränkt.

Unser Basisszenario für die Jahre 2022 und 2023 geht weiterhin davon aus, dass sich Wachstum und Inflation abkühlen und zum Trendniveau zurückkehren werden. Dadurch sollte der Druck auf die politischen Entscheidungsträger, die Zinsen im kommenden Jahr aggressiv anzuheben, zurückgehen. Wir sind der Meinung, dass der Markt die erwarteten Zinserhöhungen der wichtigsten Zentralbanken inzwischen weitgehend eingepreist hat und dass das Wachstum der Unternehmensgewinne solide bleiben sollte. Vor diesem Hintergrund gehen wir davon aus, dass die Renditen von Risikoanlagen wie Aktien und Unternehmensanleihen in den kommenden zwölf bis 18 Monaten attraktiv bleiben sollten.

### Der Verwaltungsrat

#### 14. Juni 2022

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für die künftige Entwicklung. Der Wert von Anlagen und über diese erzielten Erträge kann sowohl ab- als auch zunehmen.

## Wertentwicklung

Renditen der Threadneedle (Lux) Portfolios für das Berichtsjahr zum 31. März 2022:

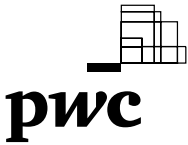
Portfolio	Einjährige Rendite*	
	Hauptanteilkasse	
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	ZU	-4,77 %
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	ZE	-5,95 %
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	ZE	-3,17 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	ZE	-0,65 %
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	ZE	-6,27 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	AE	-3,25 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	AU	-7,95 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	ZU	-6,39 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	AU	-7,91 %
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	ZU	-0,48 %
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	ZU	-5,41 %
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	ZE	2,01 %
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	AU	-2,42 %
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	ZU	0,92 %
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	ZE	-22,22 %
Threadneedle (Lux) - Global Focus	ZU	7,32 %
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	ZU	-27,84 %
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	ZU	5,31 %
Threadneedle (Lux) - Global Select	ZU	1,84 %
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	ZE	-2,70 %
Threadneedle (Lux) - American	ZU	10,71 %
Threadneedle (Lux) - American Select	ZU	9,12 %
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	ZU	1,70 %
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	ZU	-19,51 %
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	ZU	-16,55 %
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	ZU	11,43 %
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	ZU	13,90 %
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	AE	6,57 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	ZE	1,39 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	ZE	-5,24 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	ZE	-7,52 %
Threadneedle (Lux) - European Select	AE	2,32 %
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	ZE	-3,17 %
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	ZUP	-6,87 %
Threadneedle (Lux) - Global Technology	ZU	11,75 %
Threadneedle (Lux) - UK Equities	ZG	0,29 %
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	ZG	8,70 %
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity**	ZU	1,09 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	ZU	2,78 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	ZE	-2,11 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	ZE	-2,47 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	ZE	1,26 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	ZU	13,33 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ZU	-0,70 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	ZU	46,51 %

Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

\*Die Wertentwicklung ist für ein Jahr oder – für während des Geschäftsjahres aufgelegte Anteilklassen – seit dem Auflegungsdatum angegeben.

\*\*Siehe Erläuterung 1.





## Bericht des Abschlussprüfers

An die Anteilhaber von  
**Threadneedle (Lux)**

### Unser Testat

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens- und Finanzlage von Threadneedle (Lux) (der „Fonds“) und seiner einzelnen Teilfonds zum 31. März 2022 sowie der Ertragslage und der Entwicklung des Nettovermögens für das entsprechende Jahr in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung des Abschlusses.

### Was wir geprüft haben

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens für den Fonds und die Aufstellung des Nettovermögens für jeden der Teilfonds zum 31. März 2022;
- die Portfolioaufstellung zum 31. März 2022;
- die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Entwicklung des Nettovermögens für den Fonds sowie die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens für jeden der Teilfonds für das entsprechende Jahr; und
- die Erläuterungen zum Abschluss, die eine Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze enthalten.

### Grundlage für unser Testat

Wir haben unsere Prüfung unter Beachtung des Gesetzes vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (Gesetz vom 23. Juli 2016) und der von der Finanzaufsichtsbehörde „Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)“ für Luxemburg umgesetzten internationalen Abschlussprüfungsstandards (ISAs) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat darstellen.

Wir sind gemäß dem International Code of Ethics for Professional Accountants (including International Independence Standards) des International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code) in der für Luxemburg von der CSSF umgesetzten Fassung sowie den für unsere Abschlussprüfung maßgeblichen ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig. Wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen Anforderungen erfüllt.

### Sonstige Informationen

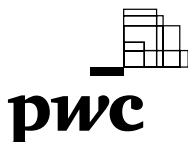
Der Verwaltungsrat ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Zu den sonstigen Informationen gehören die im Jahresbericht aufgeführten Informationen, jedoch nicht der Abschluss und unser diesbezüglicher Bericht des Abschlussprüfers.

Unsere Stellungnahme zum Abschluss deckt nicht die sonstigen Informationen ab und wir geben diesbezüglich keine versichernde Schlussfolgerung ab.

---

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg  
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, [www.pwc.lu](http://www.pwc.lu)*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n°10028256)  
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses besteht unsere Verantwortung darin, die sonstigen oben angegebenen Informationen zu lesen und dabei zu prüfen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Maße dem Abschluss oder unserem bei der Prüfung erlangten Wissen widersprechen oder anderweitig in wesentlichem Maße falsch dargestellt sind. Wenn wir aufgrund unserer durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass es eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen gibt, sind wir verpflichtet, dies zu melden. Wir haben in dieser Hinsicht jedoch nichts zu vermelden.

#### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats für den Jahresabschluss**

Der Verwaltungsrat ist verantwortlich für die Erstellung und angemessene Darstellung des Abschlusses in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Erfordernissen des Großherzogtums Luxemburg bezüglich der Erstellung und Präsentation von Abschlüssen sowie für die interne Kontrolle, die der Verwaltungsrat für notwendig erachtet, um die Erstellung eines Abschlusses zu gewährleisten, der keine wesentlichen Fehlaussagen, sei es aufgrund von Betrug oder Irrtum, enthält.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat für die Beurteilung der Fortführungsfähigkeit des Fonds und seiner einzelnen Teilfonds verantwortlich, legt Angelegenheiten im Zusammenhang mit der Unternehmensfortführung offen und wendet den Grundsatz der Unternehmensfortführung an, es sei denn, der Verwaltungsrat beabsichtigt, den Fonds zu liquidieren, einen seiner Teilfonds zu schließen oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, oder er hat hierzu keine realistische Alternative.

#### **Verantwortlichkeiten der Abschlussprüfer für die Prüfung des Abschlusses**

Ziel unserer Prüfung ist es, ausreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen ist, ganz gleich, ob diese aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern entstanden sind, und einen Bericht zu erstellen, der unser Testat enthält. Ausreichende Sicherheit bedeutet ein hohes Maß an Sicherheit. Dies ist aber keine Garantie dafür, dass eine Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs grundsätzlich bestehende wesentliche falsche Darstellungen aufdecken wird. Falsche Darstellungen können sich aus dolosen Handlungen oder Irrtümern ergeben und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise zu erwarten ist, dass sie einzeln oder in ihrer Gesamtheit die wirtschaftlichen Entscheidungen von Anlegern, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden, beeinflussen könnten.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg umgesetzten ISAs üben wir während der Prüfung pflichtgemäßes Ermessen aus und gehen mit professioneller Skepsis vor. Zu unseren weiteren Aufgaben gehören:

- die Identifizierung und Bewertung der Risiken wesentlicher falscher Angaben im Abschluss, sei es aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die eine ausreichende und geeignete Grundlage für unser Testat darstellen. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von Irrtümern, da dolose Handlungen Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, falsche Darstellungen oder die Umgehung der internen Kontrolle beinhalten können;
- die Erlangung eines Verständnisses der für die Prüfung relevanten internen Kontrollstrukturen, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Testat über die Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Fonds abzugeben;
- die Bewertung der Eignung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der Angemessenheit der vom Verwaltungsrat vorgenommenen Schätzungen und damit verbundenen Angaben;



- eine Schlussfolgerung darüber abzugeben, ob der vom Verwaltungsrat angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist, und ob auf der Grundlage der gewonnenen Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Umstände besteht, die erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds begründen können. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die entsprechenden Angaben im Abschluss hinzuweisen, oder, falls diese Angaben nicht ausreichend sind, unser Testat zu ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfungsnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Prüfungsberichts erhalten haben. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds (mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity, dessen Auflösung beschlossen wurde) nicht mehr fortgeführt werden kann;
- die Beurteilung der Gesamtdarstellung, der Struktur und des Inhalts des Abschlusses, einschließlich der Abschlussangaben, und der Frage, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellt, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild entsteht.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen unter anderem über den geplanten Umfang und Zeitpunkt der Prüfung und wesentliche Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger wesentlicher Mängel im internen Kontrollsystem, die wir im Rahmen unserer Prüfung feststellen.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 15. Juni 2022

Serene Shtayyeh

## Konsolidierter Abschluss für Threadneedle (Lux)

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2, 18	20.323.849.448
Bankguthaben	2	197.378.262
Termineinlagen	2, 19	31.244.761
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		196.644.402
Forderungen aus Zeichnungen		68.010.529
Zinsforderungen aus Swaps	2	3.822.020
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		50.307.898
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	25.141.442
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	20.013.855
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	28.242.920
Sonstige Aktiva		10.530.456
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>20.955.185.993</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(288.723)
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(708.254)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(231.724.129)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(35.271.120)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(3.463.343)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(967.341)
Fällige Bankzinsen	2	(7.337)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(1.689.716)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(27.295.765)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(1.768.765)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(17.194.686)
Steuerverbindlichkeit	3	(1.446.527)
Sonstige Passiva	20	(8.776.770)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(330.602.476)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>20.624.583.517</b>

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>23.052.196.950</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	203.578.017
Zinsen aus Anleihen, netto	2	117.592.622
Zinsen auf Bankguthaben	2	74.493
Zinsen aus Swaps		3.455.667
Zinsen aus Terminkontrakten		2.604
Andere Erträge		882.954
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>325.586.357</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(231.170.317)
Performancegebühren	8	(734.615)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(1.226.903)
Ausländische Steuern	3	(192.382)
Dividendenaufwand aus Swaps		(3.676.157)
Zinsaufwand aus Swaps		(32.882.593)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(801.982)
Betriebskosten	3, 5	(44.604.267)
Sonstige Gebühren	4	(10.533)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(315.299.749)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>10.286.608</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.646.875.337
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		156.500.300
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(40.858)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(103.314.752)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		6.636.680
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(7.163.215)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		115
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.699.493.607</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.911.704.600)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		62.008.092
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Optionen		(168.444)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		37.642.762
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		21.310.773
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(1.790.911.417)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(81.131.202)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		7.565.792.461
Anteilrücknahmen		(9.097.597.185)
Dividenden	7	(48.155.644)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(1.579.960.368)</b>
Wechselkursdifferenzen	2	(778.815.885)
Änderung der Überkreuzbeteiligungen in Portfolios	18	12.294.022
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>20.624.583.517</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	494.660.789
Bankguthaben	2	6.036.806
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.401.125
Forderungen aus Zeichnungen		726.812
Zinsforderungen aus Swaps	2	48.455
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		3.990.053
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	7.171.721
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	1.674.191
Sonstige Aktiva		28.197
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>515.738.149</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(450.359)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(657.620)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(88.690)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.487.127)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(125.639)
Sonstige Passiva		(70.928)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.880.363)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>512.857.786</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	1.473.330,453
Klasse AEH	957.407,951
Klasse AKH	70,000
Klasse ANH	788,000
Klasse AU	983.950,414
Klasse AUP	118.898,937
Klasse DEC	77.981,486
Klasse DEH	196.932,131
Klasse DU	204.766,131
Klasse DUP	67.986,651
Klasse IEC	629.450,498
Klasse IEH	1.166.051,037
Klasse IEP	74,000
Klasse IGC	1.072,350
Klasse IGH	1.618.029,313
Klasse IKH	80.378,000
Klasse INH	785,000
Klasse IU	621.088,590
Klasse IUP	578.366,295
Klasse NEC	206.526,610
Klasse NEH	108.095,495
Klasse NGC	11.905.046,184
Klasse NGH	1.044.866,570
Klasse NU	1.544.980,902
Klasse NUP	89.705,000
Klasse XEH	84,000
Klasse XFH	92,000
Klasse XGH	9.608.393,047
Klasse XU	100,000
Klasse ZEH	4.084.775,735
Klasse ZFH	93,000
Klasse ZGH	29.365,171
Klasse ZU	1.818.830,862

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>505.611.566</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.907
Zinsen aus Anleihen, netto	2	12.496.293
Zinsen auf Bankguthaben	2	4.288
Zinsen aus Swaps		311.569
Zinsen aus Terminkontrakten		314
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>12.818.371</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.645.818)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(34.416)
Zinsaufwand aus Swaps		(1.819.363)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(17.352)
Betriebskosten	3, 5	(899.172)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.416.121)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>8.402.250</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		2.494.382
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(1.096.485)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(16.676.586)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(964.236)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.972.102)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(18.215.027)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(53.536.994)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		2.513.588
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		8.249.277
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		2.019.254
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(40.754.875)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(50.567.652)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		198.795.074
Anteilrücknahmen		(135.955.316)
Dividenden	7	(5.025.886)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>57.813.872</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>512.857.786</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	512.857.786	505.611.566	231.720.967

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	9,8883 <sup>1</sup>	10,7710 <sup>1</sup>	10,1688 <sup>1</sup>
Klasse AEH	11,3032 <sup>1</sup>	12,0116 <sup>1</sup>	11,0413 <sup>1</sup>
Klasse AKH	113,5556 <sup>2</sup>	120,4075 <sup>2</sup>	110,4036 <sup>2</sup>
Klasse ANH	10,1321 <sup>3</sup>	10,6766 <sup>3</sup>	9,7591 <sup>3</sup>
Klasse AU	12,8471	13,5238	12,3096
Klasse AUP	11,3413	12,2255	11,4274
Klasse DEC	8,9807 <sup>1</sup>	9,8546 <sup>1</sup>	9,3773 <sup>1</sup>
Klasse DEH	10,7729 <sup>1</sup>	11,5352 <sup>1</sup>	10,6831 <sup>1</sup>
Klasse DU	11,1512	11,8269	10,8459
Klasse DUP	10,0429	10,9155	10,2875
Klasse IEC	9,7281 <sup>1</sup>	10,5732 <sup>1</sup>	9,9649 <sup>1</sup>
Klasse IEH	11,6146 <sup>1</sup>	12,3172 <sup>1</sup>	11,3035 <sup>1</sup>
Klasse IEP	11,0997 <sup>1</sup>	11,3003 <sup>1</sup>	11,3172 <sup>1</sup>
Klasse IGC	10,0201 <sup>4</sup>	10,8060 <sup>4</sup>	10,1319 <sup>4</sup>
Klasse IGH	12,4075 <sup>4</sup>	13,0594 <sup>4</sup>	11,9152 <sup>4</sup>
Klasse IKH	116,6619 <sup>2</sup>	123,3018 <sup>2</sup>	112,7923 <sup>2</sup>
Klasse INH	10,2127 <sup>3</sup>	10,7232 <sup>3</sup>	9,7783 <sup>3</sup>
Klasse IU	13,1938	13,8609	12,5914
Klasse IUP	10,5391	11,3406	10,5721
Klasse NEC	9,8160 <sup>1</sup>	10,6452 <sup>1</sup>	10,0163 <sup>1</sup>
Klasse NEH	10,5687 <sup>1</sup>	11,1857 <sup>1</sup>	10,2441 <sup>1</sup>
Klasse NGC	9,8219 <sup>4</sup>	10,5683 <sup>4</sup>	9,8807 <sup>4</sup>
Klasse NGH	10,9467 <sup>4</sup>	11,4987 <sup>4</sup>	10,4701 <sup>4</sup>
Klasse NU	11,4874	12,0441	10,9192
Klasse NUP	10,6244	11,4076	10,6268
Klasse XEH	9,3311 <sup>1</sup>	9,8476 <sup>1</sup>	–
Klasse XFH	9,2943 <sup>5</sup>	9,8342 <sup>5</sup>	–
Klasse XGH	10,8105 <sup>4</sup>	11,3216 <sup>4</sup>	10,2784 <sup>4</sup>
Klasse XU	9,4664	9,8938	–
Klasse ZEH	10,6577 <sup>1</sup>	11,2951 <sup>1</sup>	10,3599 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	9,2148 <sup>5</sup>	9,8121 <sup>5</sup>	–
Klasse ZGH	12,3692 <sup>4</sup>	13,0122 <sup>4</sup>	11,8664 <sup>4</sup>
Klasse ZU	13,1713	13,8304	12,5574

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	124.952.906
Bankguthaben	2	1.319.464
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.269.349
Zinsforderungen aus Swaps	2	13.713
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		744.400
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	774.093
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>129.073.925</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(863.517)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(24.715)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(22.171)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(79.923)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(354.847)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(38.441)
Sonstige Passiva		(15.107)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.398.721)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>127.675.204</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	95.025,182
Klasse ANH	825,000
Klasse IE	3.487.045,137
Klasse IEP	85,000
Klasse INH	817,000
Klasse XE	84,000
Klasse XFH	92,000
Klasse XGH	72,000
Klasse XUH	100,000
Klasse ZE	78,000
Klasse ZFH	92,000
Klasse 1E	6.168.776,381
Klasse 1G	141.654,881
Klasse 2E	3.812.179,971
Klasse 2G	69,000
Klasse 3G	558.328,721
Klasse 4E	236.424,367
Klasse 4G	3.113.105,156
Klasse 8E	892.429,248
Klasse 8G	132.809,810
Klasse 9G	70,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR	
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>157.999.564</b>	
<b>Ertrag</b>			
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.892.090	
Zinsen auf Bankguthaben	2	119	
Zinsen aus Swaps		86.934	
Andere Erträge		561	
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.979.704</b>	
<b>Aufwand</b>			
Anlageverwaltungsgebühren	5	(493.993)	
Zinsen auf Bankguthaben	2	(24.942)	
Zinsaufwand aus Swaps		(410.242)	
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(3.527)	
Betriebskosten	3, 5	(170.393)	
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.103.097)</b>	
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>876.607</b>	
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.490.457	
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(102.907)	
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(583.941)	
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		176.670	
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(26.970)	
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>953.309</b>	
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(10.422.614)	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		425.794	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		26.286	
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		624.788	
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(9.345.746)</b>	
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(7.515.830)</b>	
<b>Kapitalbewegungen</b>			
Zeichnungen von Anteilen		15.338.278	
Anteilrücknahmen		(38.146.796)	
Dividenden	7	(12)	
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(22.808.530)</b>	
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>127.675.204</b>	
<b>GESAMTNETTOINVENTARWERT</b>			
EUR	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
	127.675.204	157.999.564	127.139.343

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	10,1243	10,7975	9,9041
Klasse ANH	9,8409 <sup>1</sup>	10,4217 <sup>1</sup>	9,4949 <sup>1</sup>
Klasse IE	10,3374	10,9588	9,9912
Klasse IEP <sup>#</sup>	9,2711	–	–
Klasse INH	9,9943 <sup>1</sup>	10,5063 <sup>1</sup>	9,5194 <sup>1</sup>
Klasse XE	9,5748	10,1073	–
Klasse XFH	9,5292 <sup>2</sup>	10,0938 <sup>2</sup>	–
Klasse XGH	9,6585 <sup>3</sup>	10,1315 <sup>3</sup>	–
Klasse XUH	9,6777 <sup>4</sup>	10,1441 <sup>4</sup>	–
Klasse ZE	10,2805	10,9309	9,9786
Klasse ZFH	9,4512 <sup>2</sup>	10,0801 <sup>2</sup>	–
Klasse 1E	1,3811	1,4728	1,3507
Klasse 1G	1,0743 <sup>3</sup>	1,1548 <sup>3</sup>	1,1002 <sup>3</sup>
Klasse 2E	10,3490	10,9688	9,9984
Klasse 2G	9,7243 <sup>3</sup>	10,3939 <sup>3</sup>	9,8457 <sup>3</sup>
Klasse 3G	1,2099 <sup>3</sup>	1,2941 <sup>3</sup>	1,2267 <sup>3</sup>
Klasse 4E	10,4502	11,0208	–
Klasse 4G	10,1679 <sup>3</sup>	10,8094 <sup>3</sup>	10,1845 <sup>3</sup>
Klasse 8E	1,7338	1,8383	1,6764
Klasse 8G	1,4667 <sup>3</sup>	1,5677 <sup>3</sup>	1,4850 <sup>3</sup>
Klasse 9G	9,7021 <sup>3</sup>	10,3783 <sup>3</sup>	9,8373 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.



## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	433.156.272
Bankguthaben	2	1.043.210
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		6.367.092
Forderungen aus Zeichnungen		75.950
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		5.427.507
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.221.168
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	93.545
Sonstige Aktiva		23.350
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>447.408.094</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.553.473)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(6.922.052)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(306.895)
Sonstige Passiva		(62.382)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(9.844.802)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>437.563.292</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	342,253
Klasse AKH	81,000
Klasse ANH	807,000
Klasse IE	4.894.295,707
Klasse IEP	5.524.522,913
Klasse IKH	80,000
Klasse INH	798,000
Klasse XE	77,000
Klasse ZE	46.685,677
Klasse ZEP	473.149,000
Klasse 1E	13.253.531,629
Klasse 1EP	1.276.410,305
Klasse 1G	281.757,587
Klasse 1GP	4.413,675
Klasse 1UT	287.966,873
Klasse 2E	29.925,000
Klasse 2EP	84,000
Klasse 2FH	6.834,346
Klasse 2G	68,000
Klasse 2GP	75,000
Klasse 3E	3.178.135,347
Klasse 3EP	2.299.433,247
Klasse 3FC	13.176,825
Klasse 3FH	38.048,936
Klasse 3G	864.985,116
Klasse 3GP	102.573,702
Klasse 4E	122.047,648
Klasse 4G	1.383.622,706
Klasse 8E	1.592.475,724
Klasse 8EP	5.555.524,634
Klasse 8FH	32.415,940
Klasse 8G	9.694,366
Klasse 8GP	5.021,867
Klasse 9E	1.183.814,572
Klasse 9EP	7.573,873
Klasse 9FC	92,741
Klasse 9FH	2.306,914
Klasse 9G	67,000
Klasse 9GP	75,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>601.800.632</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.261
Zinsen aus Anleihen, netto	2	19.982.473
Zinsen auf Bankguthaben	2	944
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>19.984.678</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(4.289.906)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(27.497)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(6.790)
Betriebskosten	3, 5	(894.776)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(5.218.969)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>14.765.709</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		5.958.865
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.441.547)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		27.105
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.166.373)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>3.378.050</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(33.069.576)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.582.416
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		93.545
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(31.393.615)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(13.249.856)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		112.945.621
Anteilrücknahmen		(258.204.398)
Dividenden	7	(5.728.707)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(150.987.484)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>437.563.292</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	437.563.292	601.800.632	476.354.207

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	10,7825	11,2181	–
Klasse AKH	101,0117 <sup>1</sup>	104,9357 <sup>1</sup>	88,6643 <sup>1</sup>
Klasse ANH	10,2186 <sup>2</sup>	10,5488 <sup>2</sup>	8,8954 <sup>2</sup>
Klasse IE	10,8198	11,1683	9,3892
Klasse IEP	9,3088	9,9899	8,7058
Klasse IKH	102,8317 <sup>1</sup>	105,8588 <sup>1</sup>	88,9089 <sup>1</sup>
Klasse INH	10,4003 <sup>2</sup>	10,6479 <sup>2</sup>	8,9222 <sup>2</sup>
Klasse XE	10,5517	10,8140	9,0281
Klasse ZE	10,7962	11,1495	9,3780
Klasse ZEP	9,2891	9,9735	8,7007
Klasse 1E	10,6162	11,0164	9,3105
Klasse 1EP	9,1329	9,8573	8,6466
Klasse 1G	9,9707 <sup>3</sup>	10,4297 <sup>3</sup>	9,1568 <sup>3</sup>
Klasse 1GP	8,6028 <sup>3</sup>	9,3569 <sup>3</sup>	8,5225 <sup>3</sup>
Klasse 1UT	9,8080 <sup>4</sup>	10,4752 <sup>4</sup>	9,1107 <sup>4</sup>
Klasse 2E	10,8306	11,1761	9,3929
Klasse 2EP	9,3488	10,0267	8,7357
Klasse 2FH	10,6851 <sup>5</sup>	11,0615 <sup>5</sup>	9,3252 <sup>5</sup>
Klasse 2G	10,1723 <sup>3</sup>	10,5872 <sup>3</sup>	9,2443 <sup>3</sup>
Klasse 2GP	8,7869 <sup>3</sup>	9,4995 <sup>3</sup>	8,5956 <sup>3</sup>
Klasse 3E	10,8528	11,1933	9,4027
Klasse 3EP	9,4075	10,0878	8,7895
Klasse 3FC	9,2459 <sup>5</sup>	9,9302 <sup>5</sup>	8,6906 <sup>5</sup>
Klasse 3FH	10,7045 <sup>5</sup>	11,0760 <sup>5</sup>	9,3331 <sup>5</sup>
Klasse 3G	10,1921 <sup>3</sup>	10,5964 <sup>3</sup>	9,2468 <sup>3</sup>
Klasse 3GP	8,7267 <sup>3</sup>	9,4331 <sup>3</sup>	8,5390 <sup>3</sup>
Klasse 4E	11,1273	11,3964	9,5067
Klasse 4G	10,6900 <sup>3</sup>	11,0365 <sup>3</sup>	9,5632 <sup>3</sup>
Klasse 4GP	–	–	8,7170 <sup>3</sup>
Klasse 8E	10,8147	11,1642	9,3866
Klasse 8EP	9,3469	10,0322	8,7498
Klasse 8FH	10,6685 <sup>5</sup>	11,0486 <sup>5</sup>	9,3179 <sup>5</sup>
Klasse 8G	10,1593 <sup>3</sup>	10,5718 <sup>3</sup>	9,2336 <sup>3</sup>
Klasse 8GP	8,7611 <sup>3</sup>	9,4964 <sup>3</sup>	8,6037 <sup>3</sup>
Klasse 9E	10,8653	11,2018	9,4061
Klasse 9EP	9,4214	10,0992	8,7964
Klasse 9FC	9,3284 <sup>5</sup>	10,0032 <sup>5</sup>	8,7510 <sup>5</sup>
Klasse 9FH	10,7239 <sup>5</sup>	11,0918 <sup>5</sup>	9,3420 <sup>5</sup>
Klasse 9G	10,2232 <sup>3</sup>	10,6161 <sup>3</sup>	9,2545 <sup>3</sup>
Klasse 9GP	8,8161 <sup>3</sup>	9,5122 <sup>3</sup>	8,6021 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	104.929.913
Bankguthaben	2	2.186.678
Forderungen aus Zeichnungen		274.785
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.884
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.190.917
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	467.526
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	10.110
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>109.061.813</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(766.656)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.048)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.799)
Sonstige Passiva		(9.200)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(780.703)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>108.281.110</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	2.810,385
Klasse AEP	167,669
Klasse AKH	82,000
Klasse ANH	82,000
Klasse IE	30.849,438
Klasse IEP	84.150,000
Klasse IGC	8,000
Klasse IGH	7,000
Klasse IKH	82,000
Klasse INH	816,000
Klasse XE	33.727,830
Klasse XGC	71.543,876
Klasse XGH	677.289,644
Klasse ZE	8,200

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	102,3925	103,3869	89,6665
Klasse AEP	92,7591	97,3234	87,4074
Klasse AKH	102,9071 <sup>1</sup>	103,6634 <sup>1</sup>	89,7046 <sup>1</sup>
Klasse ANH	104,6701 <sup>2</sup>	104,8255 <sup>2</sup>	90,4760 <sup>2</sup>
Klasse IE	103,5067	104,0942	89,9208
Klasse IEP	93,8051	97,9620	87,6410
Klasse IGC	95,6430 <sup>3</sup>	99,1215 <sup>3</sup>	88,1422 <sup>3</sup>
Klasse IGH	105,1039 <sup>3</sup>	105,0674 <sup>3</sup>	90,3604 <sup>3</sup>
Klasse IKH	103,4243 <sup>1</sup>	103,8150 <sup>1</sup>	89,4959 <sup>1</sup>
Klasse INH	10,4750 <sup>2</sup>	10,4542 <sup>2</sup>	8,9899 <sup>2</sup>
Klasse XE	104,6355	104,8093	90,1780
Klasse XGC	96,4461 <sup>3</sup>	99,6631 <sup>3</sup>	88,3048 <sup>3</sup>
Klasse XGH	106,2932 <sup>3</sup>	105,8053 <sup>3</sup>	90,6104 <sup>3</sup>
Klasse ZE	103,3293	104,0037	89,8970

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>87.774.729</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	3.738.375
Zinsen auf Bankguthaben	2	374
Zinsen aus Swaps		62.523
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.801.272</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(24.915)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(14.961)
Betriebskosten	3, 5	(103.620)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(143.496)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>3.657.776</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(369.714)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.999.866
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(429.636)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.200.516</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(3.327.457)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(53.691)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(396.279)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(3.777.427)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>1.080.865</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		27.219.031
Anteilrücknahmen		(7.179.466)
Dividenden	7	(614.049)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>19.425.516</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>108.281.110</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	108.281.110	87.774.729	46.407.346

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	392.379.537
Bankguthaben	2	3.117.721
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		4.330.317
Forderungen aus Zeichnungen		694.407
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.038.016
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	544.590
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	629.872
Sonstige Aktiva		186
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>403.734.646</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(5.542.827)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.033.477)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(102.628)
Sonstige Passiva		(39.404)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(6.718.336)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>397.016.310</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.691.848,606
Klasse AEP	44.986,000
Klasse AFH	93,000
Klasse AKH	86,000
Klasse ANH	861,000
Klasse ASC	100,000
Klasse ASH	100,000
Klasse AUC	100,000
Klasse AUH	100,000
Klasse ID	22.738.015,068
Klasse IE	5.082.316,581
Klasse IEP	2.852.290,955
Klasse IFH	2.425.182,000
Klasse IGH	351,000
Klasse IKH	85,000
Klasse INH	839,000
Klasse ISC	100,000
Klasse ISH	100,000
Klasse IUC	93.502,243
Klasse IUH	100,000
Klasse LE	3.762.364,166
Klasse NEP	98.063,469
Klasse ZD	11.963.717,696
Klasse ZE	4.283.570,639
Klasse ZEP	608.627,379
Klasse ZFH	35.589,000
Klasse ZGC	3.705.143,891
Klasse ZGH	898.542,981
Klasse ZUH	1.505,141

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>329.896.379</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	4.128.364
Zinsen auf Bankguthaben	2	556
Zinsen aus Terminkontrakten		24
Andere Erträge		15
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.128.959</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.175.937)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(27.994)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(4.481)
Betriebskosten	3, 5	(440.325)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.648.737)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.480.222</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.858.070)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(705.599)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		1.271.757
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		266.594
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(2.025.318)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(25.650.147)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		703.190
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		409.686
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(24.537.271)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(24.082.367)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		174.637.963
Anteilrücknahmen		(81.652.736)
Dividenden	7	(1.782.929)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>91.202.298</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>397.016.310</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	397.016.310	329.896.379	154.103.742

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	9,3388	9,9729	–
Klasse AEP	9,1831	9,9137	–
Klasse AFH	9,3172 <sup>1</sup>	9,9710 <sup>1</sup>	–
Klasse AKH	93,6342 <sup>2</sup>	99,5278 <sup>2</sup>	–
Klasse ANH	9,4392 <sup>3</sup>	9,9762 <sup>3</sup>	–
Klasse ASC	9,3030 <sup>4</sup>	9,9703 <sup>4</sup>	–
Klasse ASH	9,4156 <sup>4</sup>	9,9784 <sup>4</sup>	–
Klasse AUC	9,3072 <sup>5</sup>	9,9704 <sup>5</sup>	–
Klasse AUH	9,4257 <sup>5</sup>	9,9792 <sup>5</sup>	–
Klasse ID	9,4617 <sup>6</sup>	10,0874 <sup>6</sup>	9,5778 <sup>6</sup>
Klasse IE	10,0871	10,7559	10,1785
Klasse IEP	9,4700	10,2088	9,7761
Klasse IFH	9,8039 <sup>1</sup>	10,4909 <sup>1</sup>	9,9642 <sup>1</sup>
Klasse IGH	9,4189 <sup>7</sup>	9,9775 <sup>7</sup>	–
Klasse IKH	94,8504 <sup>2</sup>	100,7592 <sup>2</sup>	95,0380 <sup>2</sup>
Klasse INH	9,6877 <sup>3</sup>	10,2330 <sup>3</sup>	9,6122 <sup>3</sup>
Klasse ISC	9,3048 <sup>4</sup>	9,9703 <sup>4</sup>	–
Klasse ISH	9,4173 <sup>4</sup>	9,9784 <sup>4</sup>	–
Klasse IUC	9,3112 <sup>5</sup>	9,9711 <sup>5</sup>	–
Klasse IUH	9,4334 <sup>5</sup>	9,9799 <sup>5</sup>	–
Klasse LE	10,1185	10,7895	10,2060
Klasse NEP	954,3554	1028,6742	984,7206
Klasse ZD	9,4477 <sup>6</sup>	10,0776 <sup>6</sup>	9,5733 <sup>6</sup>
Klasse ZE	10,0568	10,7290	10,1580
Klasse ZEP	9,4219	10,1616	9,7334
Klasse ZFH	9,7912 <sup>1</sup>	10,4827 <sup>1</sup>	9,9581 <sup>1</sup>
Klasse ZGC	9,7886 <sup>7</sup>	10,4934 <sup>7</sup>	–
Klasse ZGH	10,0164 <sup>7</sup>	10,6218 <sup>7</sup>	–
Klasse ZUH	9,6718 <sup>5</sup>	10,2472 <sup>5</sup>	–

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>6</sup>Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>7</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	177.858.523
Bankguthaben	2	6.563.505
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		646.663
Forderungen aus Zeichnungen		99.234
Zinsforderungen aus Swaps	2	65.800
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.968.262
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	3.525.916
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>190.727.903</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.050.607)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(136.846)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(115.367)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(806.574)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(1.924.769)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(144.719)
Sonstige Passiva		(35.582)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(4.214.464)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>186.513.439</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	2.623.051,127
Klasse AEP	679.856,829
Klasse AKH	81,000
Klasse ANH	802,000
Klasse AUH	86,000
Klasse DE	1.105.282,993
Klasse DEP	1.596.548,422
Klasse DUH	87,000
Klasse IE	1.618.286,833
Klasse INH	792,000
Klasse ZE	85,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	30,0762	31,0867	27,7686
Klasse AEP	14,5050	15,3978	14,1492
Klasse AKH	102,4839 <sup>1</sup>	105,8567 <sup>1</sup>	94,4608 <sup>1</sup>
Klasse ANH	10,4094 <sup>2</sup>	10,6864 <sup>2</sup>	9,5087 <sup>2</sup>
Klasse AUH	11,3753 <sup>3</sup>	11,6784 <sup>3</sup>	10,3501 <sup>3</sup>
Klasse DE	28,0352	29,1371	26,1701
Klasse DEP	10,8231	11,5522	10,6750
Klasse DUH	11,1164 <sup>3</sup>	11,4774 <sup>3</sup>	10,2405 <sup>3</sup>
Klasse IE	30,5812	31,4196	27,8985
Klasse INH	10,6102 <sup>2</sup>	10,8071 <sup>2</sup>	9,5432 <sup>2</sup>
Klasse W	—	—	58,8490
Klasse ZE <sup>f</sup>	9,6862	—	—

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>f</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>234.144.701</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.951.518
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.313
Zinsen aus Swaps		334.428
Andere Erträge		7
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>6.287.266</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.967.646)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(64.171)
Zinsaufwand aus Swaps		(2.303.022)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(26.042)
Betriebskosten	3, 5	(485.730)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.846.611)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.440.655</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.257.861
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		366.781
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.097.840)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		1.043.209
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(220.861)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(650.850)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(13.006.234)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.672.668
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		829.090
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		2.921.471
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(7.583.005)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(6.793.200)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		64.763.421
Anteilrücknahmen		(104.797.313)
Dividenden	7	(804.170)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(40.838.062)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>186.513.439</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	186.513.439	234.144.701	165.029.205

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	39.699.398
Bankguthaben	2	809.788
Forderungen aus Zeichnungen		41.771
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		457.083
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	305.532
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	192.573
Sonstige Aktiva		22
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>41.506.167</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(400.000)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(62.244)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(37.886)
Sonstige Passiva		(9.014)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(509.144)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>40.997.023</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	390.778,324
Klasse AEH	255.056,770
Klasse AKH	80,000
Klasse ANH	792,000
Klasse ASH	7.301,436
Klasse AU	140.646,184
Klasse AUP	725.872,284
Klasse DEC	43.808,952
Klasse DEH	127.590,832
Klasse DU	216.237,424
Klasse IEC	194.086,000
Klasse IEH	405.978,626
Klasse IU	2.093,260
Klasse W	6.537,236
Klasse WEH	7.298,489
Klasse XUP	85,000
Klasse ZU	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>47.451.659</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.262
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.003.954
Zinsen auf Bankguthaben	2	426
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.005.642</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(542.973)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(47)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(108)
Betriebskosten	3, 5	(129.048)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(672.176)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.333.466</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(332.551)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.126.932)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		237.453
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(59.240)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(3.281.270)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(4.840.486)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		776.382
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		192.573
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(3.871.531)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(5.819.335)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		13.444.852
Anteilrücknahmen		(13.402.373)
Dividenden	7	(677.780)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(635.301)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>40.997.023</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	40.997.023	47.451.659	33.146.518

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	11,3376 <sup>1</sup>	12,9505 <sup>1</sup>	11,4485 <sup>1</sup>
Klasse AEH	20,5319 <sup>1</sup>	22,5246 <sup>1</sup>	19,0129 <sup>1</sup>
Klasse AKH	96,8799 <sup>2</sup>	105,9916 <sup>2</sup>	89,1452 <sup>2</sup>
Klasse ANH	9,8352 <sup>3</sup>	10,6943 <sup>3</sup>	8,9692 <sup>3</sup>
Klasse ASH	13,7388 <sup>4</sup>	14,9331 <sup>4</sup>	12,5045 <sup>4</sup>
Klasse AU	21,9017	23,7934	19,8691
Klasse AUP	7,3555	8,3207	7,2747
Klasse DEC	8,2123 <sup>1</sup>	9,3896 <sup>1</sup>	8,3093 <sup>1</sup>
Klasse DEH	15,7465 <sup>1</sup>	17,2924 <sup>1</sup>	14,6111 <sup>1</sup>
Klasse DU	17,0502	18,5415	15,4989
Klasse IEC	8,6232 <sup>1</sup>	9,7778 <sup>1</sup>	–
Klasse IEH	29,1681 <sup>1</sup>	31,7423 <sup>1</sup>	26,5802 <sup>1</sup>
Klasse IU	11,2198	12,0940	10,0191
Klasse W	30,0194	32,4983	27,0437
Klasse WEH	20,1302 <sup>1</sup>	22,0058 <sup>1</sup>	18,5115 <sup>1</sup>
Klasse XUP	10,5075	11,7343	10,0921
Klasse ZU <sup>5</sup>	9,1419	–	–

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>5</sup>Siehe Erläuterung 1.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	33.637.866
Bankguthaben	2	1.140.981
Forderungen aus Zeichnungen		12.146
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		453.334
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	27.205
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	40.788
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>35.312.320</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(87.667)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(39.839)
Sonstige Passiva		(8.908)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(136.414)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>35.175.906</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	48.882,369
Klasse AEH	13.030,738
Klasse AKH	82,000
Klasse ANH	818,000
Klasse ASH	2.362,302
Klasse AU	53.075,471
Klasse AUP	2.772.282,752
Klasse DEH	10.133,563
Klasse DU	20.420,379
Klasse IEH	17.880,178
Klasse IU	89,000
Klasse SU	403,299
Klasse SUP	48.638,874
Klasse W	4.779,568
Klasse XUP	89,000
Klasse ZU	76,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	8,0881 <sup>1</sup>	9,2177 <sup>1</sup>	8,1700 <sup>1</sup>
Klasse AEH	24,6916 <sup>1</sup>	26,8384 <sup>1</sup>	22,6402 <sup>1</sup>
Klasse AKH	92,6360 <sup>2</sup>	100,7566 <sup>2</sup>	84,8443 <sup>2</sup>
Klasse ANH	9,3882 <sup>3</sup>	10,1328 <sup>3</sup>	8,5211 <sup>3</sup>
Klasse ASH	11,7200 <sup>4</sup>	12,6134 <sup>4</sup>	10,5597 <sup>4</sup>
Klasse AU	73,6637	79,1694	66,0483
Klasse AUP	10,0463	11,3182	9,9193
Klasse DEH	18,3325 <sup>1</sup>	19,9465 <sup>1</sup>	16,8452 <sup>1</sup>
Klasse DU	52,3331	56,3008	47,0167
Klasse IEH	27,2289 <sup>1</sup>	29,3633 <sup>1</sup>	24,5729 <sup>1</sup>
Klasse IU	10,1566	10,8581	9,0048
Klasse SU	29,5378	31,7934	26,5644
Klasse SUP	9,6466	10,8819	9,5489
Klasse W	61,5266	65,8940	54,7816
Klasse XUP	9,8204	10,9029	9,3824
Klasse ZU	11,8658	12,6758	10,4968

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>45.515.822</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	567
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.992.042
Zinsen auf Bankguthaben	2	271
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.992.880</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(570.873)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(378)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(83)
Betriebskosten	3, 5	(127.138)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(698.472)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.294.408</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(750.206)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(159.313)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		128.713
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(18.310)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(799.116)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(3.275.742)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		55.889
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		40.788
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(3.179.065)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(2.683.773)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		602.753
Anteilrücknahmen		(6.638.780)
Dividenden	7	(1.620.116)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(7.656.143)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>35.175.906</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	35.175.906	45.515.822	45.432.000

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	87.794.622
Bankguthaben	2	2.481.592
Forderungen aus Zeichnungen		673
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.148.159
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	334.184
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>91.759.230</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(520.748)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(61.763)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(49.615)
Sonstige Passiva		(18.680)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(650.806)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>91.108.424</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	2.487.668,829
Klasse AEH	195.357,691
Klasse AKH	85,000
Klasse ANH	835,000
Klasse ASC	45.700,410
Klasse ASH	17.295,465
Klasse AU	651.708,503
Klasse AUP	1.449.094,720
Klasse DEH	97.589,350
Klasse DU	140.352,178
Klasse IE	93.034,332
Klasse IEH	732.359,331
Klasse XU	3.401.210,546
Klasse XUP	364.027,797
Klasse ZEH	15.664,000
Klasse ZU	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	4,6270 <sup>1</sup>	5,3304 <sup>1</sup>	4,8028 <sup>1</sup>
Klasse AEH	13,9674 <sup>1</sup>	15,3274 <sup>1</sup>	13,1271 <sup>1</sup>
Klasse AKH	91,6130 <sup>2</sup>	100,3800 <sup>2</sup>	85,8647 <sup>2</sup>
Klasse ANH	9,3476 <sup>3</sup>	10,1668 <sup>3</sup>	8,6667 <sup>3</sup>
Klasse ASC	6,3399 <sup>4</sup>	7,2335 <sup>4</sup>	6,4712 <sup>4</sup>
Klasse ASH	10,5249 <sup>4</sup>	11,4387 <sup>4</sup>	9,7217 <sup>4</sup>
Klasse AU	17,1041	18,5735	15,7370
Klasse AUP	4,9572	5,6508	5,0421
Klasse DEH	10,8662 <sup>1</sup>	11,9416 <sup>1</sup>	10,2427 <sup>1</sup>
Klasse DU	13,2928	14,4565	12,2671
Klasse IE	9,6301 <sup>1</sup>	9,8260 <sup>1</sup>	8,8511 <sup>1</sup>
Klasse IEH	16,0698 <sup>1</sup>	17,5011 <sup>1</sup>	14,8774 <sup>1</sup>
Klasse XU	10,6176	11,3638	9,4901
Klasse XUP	8,6646	9,7360	8,5602
Klasse ZEH	10,3126 <sup>1</sup>	11,2373 <sup>1</sup>	9,5569 <sup>1</sup>
Klasse ZU <sup>4</sup>	9,1782	—	—

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>5</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>115.675.743</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.271
Zinsen aus Anleihen, netto	2	5.121.686
Zinsen auf Bankguthaben	2	585
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>5.124.542</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(692.904)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(34)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(89)
Betriebskosten	3, 5	(235.871)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(928.898)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>4.195.644</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.997.351)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.941.209)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(208.141)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(46.834)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(5.193.535)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(8.933.278)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		931.585
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(111.537)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(8.113.230)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(9.111.121)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		9.195.323
Anteilrücknahmen		(23.121.456)
Dividenden	7	(1.530.065)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(15.456.198)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>91.108.424</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	91.108.424	115.675.743	107.744.487

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	166.681.017
Bankguthaben	2	6.240.438
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		515.163
Forderungen aus Zeichnungen		23.250
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.398.641
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	793.399
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>176.651.908</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(426.000)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(8.851)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(88.181)
Sonstige Passiva		(17.223)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(540.255)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>176.111.653</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	20.459,049
Klasse AEH	18.287,196
Klasse AKH	80,000
Klasse ANH	802,000
Klasse ASH	31.102,952
Klasse AU	102.327,834
Klasse AUP	247.838,457
Klasse DEC	24.964,374
Klasse DEH	27.947,713
Klasse DU	47.050,546
Klasse IEC	92,000
Klasse IEH	2.005.113,485
Klasse IKH	79,000
Klasse INH	789,000
Klasse ISC	153.073,357
Klasse IU	7.468.794,297
Klasse TEH	4.096,803
Klasse XUP	90,000
Klasse ZFH	82,000
Klasse ZGH	58,000
Klasse ZU	312.274,525

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>210.577.608</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	10.093.257
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.649
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>10.094.906</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.174.450)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(4)
Betriebskosten	3, 5	(230.877)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.405.331)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>8.689.575</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		4.553.698
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(6.902.598)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.653)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(2.363.553)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(12.661.189)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.906.803
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(10.754.386)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(4.428.364)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		27.649.945
Anteilrücknahmen		(57.454.183)
Dividenden	7	(233.353)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(30.037.591)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>176.111.653</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	176.111.653	210.577.608	109.192.138

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	11,6239 <sup>1</sup>	12,5108 <sup>1</sup>	11,1930 <sup>1</sup>
Klasse AEH	32,0422 <sup>1</sup>	32,7344 <sup>1</sup>	27,7754 <sup>1</sup>
Klasse AKH	102,5833 <sup>2</sup>	104,5429 <sup>2</sup>	88,5458 <sup>2</sup>
Klasse ANH	10,3445 <sup>3</sup>	10,4867 <sup>3</sup>	8,8652 <sup>3</sup>
Klasse ASH	15,1131 <sup>4</sup>	15,3006 <sup>4</sup>	12,8841 <sup>4</sup>
Klasse AU	37,8984	38,3288	32,1520
Klasse AUP	12,5588	13,3803	11,8329
Klasse DEC	8,7567 <sup>1</sup>	9,4471 <sup>1</sup>	8,4645 <sup>1</sup>
Klasse DEH	23,0395 <sup>1</sup>	23,5798 <sup>1</sup>	20,0462 <sup>1</sup>
Klasse DU	27,1995	27,5635	23,1677
Klasse IEC	8,5796 <sup>1</sup>	9,1542 <sup>1</sup>	8,1216 <sup>1</sup>
Klasse IEH	32,1076 <sup>1</sup>	32,5065 <sup>1</sup>	27,3364 <sup>1</sup>
Klasse IKH	104,9731 <sup>2</sup>	105,9750 <sup>2</sup>	88,9411 <sup>2</sup>
Klasse INH	10,5900 <sup>3</sup>	10,6374 <sup>3</sup>	8,9074 <sup>3</sup>
Klasse ISC <sup>5</sup>	9,3701 <sup>4</sup>	—	—
Klasse IU	11,8564	11,8836	9,8795
Klasse TEH	11,4601 <sup>1</sup>	11,6033 <sup>1</sup>	9,7602 <sup>1</sup>
Klasse XUP	10,4751	10,9963	9,6033
Klasse ZFH	10,8909 <sup>5</sup>	11,0919 <sup>5</sup>	9,3762 <sup>5</sup>
Klasse ZGH	12,0954 <sup>6</sup>	12,2029 <sup>6</sup>	10,2390 <sup>6</sup>
Klasse ZU	13,8130	13,8794	11,5675

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>6</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>\*</sup>Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	54.819.159
Bankguthaben	2	1.823.080
Forderungen aus Zeichnungen		14.150
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		582.507
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	175.291
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	66.057
Sonstige Aktiva		49
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>57.480.293</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.858)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(14.430)
Sonstige Passiva		(8.251)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(25.539)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>57.454.754</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	93.781,956
Klasse AKH	82,000
Klasse AS	759,583
Klasse ASC	4.183,132
Klasse ASH	71.456,051
Klasse AU	131.726,682
Klasse AUP	712.242,927
Klasse AVC	100,000
Klasse AVH	100,000
Klasse DEH	66.267,132
Klasse IEH	1.163.835,552
Klasse IGH	54,000
Klasse ISH	97,000
Klasse IU	49.397,659
Klasse XU	2.336.349,409
Klasse ZU	42.070,000
Klasse ZUP	92,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	11,1546 <sup>1</sup>	11,9604 <sup>1</sup>	10,5231 <sup>1</sup>
Klasse AKH	96,2683 <sup>2</sup>	102,8729 <sup>2</sup>	90,2578 <sup>2</sup>
Klasse AS	11,0373 <sup>3</sup>	11,6426 <sup>3</sup>	10,7399 <sup>3</sup>
Klasse ASC	9,8517 <sup>3</sup>	10,8641 <sup>3</sup>	9,8642 <sup>3</sup>
Klasse ASH	12,3554 <sup>3</sup>	13,1327 <sup>3</sup>	11,4606 <sup>3</sup>
Klasse AU	12,6431	13,4327	11,6914
Klasse AUP	10,2865	11,3378	10,2697
Klasse AVC	9,3713 <sup>4</sup>	10,3878 <sup>4</sup>	9,4610 <sup>4</sup>
Klasse AVH	10,8855 <sup>4</sup>	11,6150 <sup>4</sup>	10,1653 <sup>4</sup>
Klasse DEH	10,8323 <sup>1</sup>	11,6515 <sup>1</sup>	10,2773 <sup>1</sup>
Klasse IEH	11,6988 <sup>1</sup>	12,4708 <sup>1</sup>	10,9001 <sup>1</sup>
Klasse IGH	12,4646 <sup>5</sup>	13,1827 <sup>5</sup>	11,4570 <sup>5</sup>
Klasse ISH	13,0166 <sup>3</sup>	13,7420 <sup>3</sup>	11,9152 <sup>3</sup>
Klasse IU	13,2854	14,0310	12,1334
Klasse XU	12,6016	13,2554	11,3998
Klasse ZU	13,2836	14,0429	12,1566
Klasse ZUP	9,9161	10,8803	9,8031

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>68.819.183</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.480.455
Zinsen auf Bankguthaben	2	458
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.480.913</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(212.434)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(120)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(81)
Betriebskosten	3, 5	(113.467)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(326.102)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.154.811</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(398.559)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.656.781)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		125.311
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		8.003
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(1.922.026)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(4.956.051)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		421.012
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(15.318)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(4.550.357)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(4.317.572)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		9.756.540
Anteilrücknahmen		(16.420.096)
Dividenden	7	(383.301)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(7.046.857)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>57.454.754</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	57.454.754	68.819.183	47.684.339

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	30.898.858
Bankguthaben	2	1.372.742
Termineinlagen	2, 19	641.677
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		807.631
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.117
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	352.619
Sonstige Aktiva		946
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>34.075.590</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(347.245)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(6.128)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(15.745)
Sonstige Passiva		(5.703)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(374.821)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>33.700.769</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	20.014,357
Klasse AEP	73,265
Klasse DE	31.334,261
Klasse IE	696.619,922
Klasse IEP	71,925
Klasse LE	2.086.916,591
Klasse LEP	71,870
Klasse ZE	71,748
Klasse ZEP	72,538

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	11,5219	11,3495	9,1419
Klasse AEP	11,4169	11,2520	9,0786
Klasse DE	11,1869	11,1024	9,0100
Klasse IE	11,8436	11,5850	9,2667
Klasse IEP	11,7510	11,4878	9,2021
Klasse LE	11,9147	11,6371	9,2945
Klasse LEP	11,8287	11,5394	9,2290
Klasse ZE	11,7517	11,5196	9,2308
Klasse ZEP	11,6583	11,4285	9,1673

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>31.879.013</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen auf Bankguthaben	2	319
Zinsen aus Terminkontrakten		241
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>560</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(186.282)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(18.466)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(3.697)
Betriebskosten	3, 5	(67.388)
Sonstige Gebühren	4	(8.909)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(284.742)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(284.182)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		508.184
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(136.707)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(76.019)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(33.158)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>262.300</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		339.782
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		126.911
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		298.503
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>765.196</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>743.314</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		2.456.665
Anteilrücknahmen		(1.378.222)
Dividenden	7	(1)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>1.078.442</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>33.700.769</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	33.700.769	31.879.013	26.502.999

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	40.813.583
Bankguthaben	2	4.293.576
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		325.811
Forderungen aus Zeichnungen		29.229
Zinsforderungen aus Swaps	2	14.280
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		58.212
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	279.763
Sonstige Aktiva		9.787
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>45.824.241</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(771)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(97.093)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(8.500)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(20.139)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(812.342)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(51.421)
Sonstige Passiva		(10.719)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.000.985)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>44.823.256</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	61.552,006
Klasse AEH	307.002,175
Klasse AKH	74,000
Klasse AU	331.881,458
Klasse AUP	322.825,336
Klasse DEH	105.202,605
Klasse DU	197.868,446
Klasse IEH	73,000
Klasse IGH	12.133,135
Klasse IU	217.119,983
Klasse W	5.683,832
Klasse ZU	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	13,3778 <sup>1</sup>	14,0361 <sup>1</sup>	11,8961 <sup>1</sup>
Klasse AEH	27,7017 <sup>1</sup>	28,7145 <sup>1</sup>	23,9870 <sup>1</sup>
Klasse AKH	108,2209 <sup>2</sup>	112,0590 <sup>2</sup>	93,4570 <sup>2</sup>
Klasse AU	42,0736	43,1173	35,5588
Klasse AUP	15,6687	16,2512	13,5959
Klasse DEH	19,8712 <sup>1</sup>	20,7320 <sup>1</sup>	17,4306 <sup>1</sup>
Klasse DU	27,3970	28,2598	23,4573
Klasse IEH	10,9147 <sup>1</sup>	11,2478 <sup>1</sup>	9,3386 <sup>1</sup>
Klasse IGH	28,7174 <sup>3</sup>	29,3439 <sup>3</sup>	24,2056 <sup>3</sup>
Klasse IU	31,4158	31,9704	26,1826
Klasse W	69,2136	71,0014	58,6132
Klasse ZU <sup>4</sup>	9,4818	–	–

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>58.030.727</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	309.559
Zinsen aus Anleihen, netto	2	7.171
Zinsen auf Bankguthaben	2	585
Zinsen aus Swaps		249.449
Zinsen aus Terminkontrakten		201
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>566.965</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(706.282)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(10.114)
Zinsaufwand aus Swaps		(6.154)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(10.720)
Betriebskosten	3, 5	(147.980)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(881.250)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(314.285)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		7.880.727
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		106.901
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.844.617)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(1.666.012)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(85.769)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderungen		(43)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>4.391.187</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.262.521)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(313.272)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		450.609
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(905.184)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(6.030.368)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(1.953.466)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		5.003.687
Anteilrücknahmen		(16.175.803)
Dividenden	7	(81.889)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(11.254.005)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>44.823.256</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	44.823.256	58.030.727	49.565.024

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	131.380.163
Bankguthaben	2	10.206.995
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		235.483
Forderungen aus Zeichnungen		132.922
Zinsforderungen aus Swaps	2	1.868
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		856.697
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	846.360
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	676.561
Sonstige Aktiva		39.334
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>144.376.383</b>
<b>Passiva</b>		
Zum Marktwert verkaufte Optionen	2, 12	(708.254)
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(633.451)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(188.389)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(2.556)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(26.417)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(180.772)
Sonstige Passiva		(35.987)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.775.826)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>142.600.557</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	63.760,621
Klasse AEC	4.563.335,475
Klasse AEH	714.136,941
Klasse AEP	1.840.513,862
Klasse AS	100,000
Klasse ASC	19.002,043
Klasse ASH	639,122
Klasse ASP	5.528,839
Klasse AU	458.533,368
Klasse AUM	40.835,902
Klasse AUP	1.059.816,412
Klasse DEC	2.650.332,445
Klasse DEH	250.240,508
Klasse DEP	287.247,132
Klasse DU	372.918,153
Klasse DUP	2.034.247,326
Klasse ZE	73,000
Klasse ZEC	93,000
Klasse ZEH	18.582,159
Klasse ZFH	85,000
Klasse ZU	3.067,015
Klasse ZUP	100,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>175.207.757</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.172.659
Zinsen aus Anleihen, netto	2	2.207.116
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.933
Zinsen aus Swaps		23.496
Zinsen aus Terminkontrakten		1.794
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.406.998</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.463.678)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(6.281)
Zinsaufwand aus Swaps		(66.230)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(23.079)
Betriebskosten	3, 5	(490.029)
Sonstige Gebühren	4	(73)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.049.370)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.357.628</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		7.482.265
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(56.528)
Realisierter Netto(verlust) aus Optionen		(40.858)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(3.447.863)
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(1.300.034)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(685.792)
Realisierter Netto(verlust) aus Steuerrückforderungen		(4)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.951.186</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(10.232.015)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		94.700
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Optionen		(168.444)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.600.278
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		646.452
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(8.059.029)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(4.750.215)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		14.671.315
Anteilrücknahmen		(36.601.494)
Dividenden	7	(5.926.806)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(27.856.985)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>142.600.557</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
	142.600.557	175.207.757	191.964.823

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	11,8451 <sup>1</sup>	11,1664 <sup>1</sup>	9,2855 <sup>1</sup>
Klasse AEC	7,7505 <sup>1</sup>	8,1761 <sup>1</sup>	6,7662 <sup>1</sup>
Klasse AEH	17,9084 <sup>1</sup>	18,0258 <sup>1</sup>	14,1869 <sup>1</sup>
Klasse AEP	9,4049 <sup>1</sup>	9,2989 <sup>1</sup>	8,1331 <sup>1</sup>
Klasse AQ	–	–	81,0335 <sup>2</sup>
Klasse AQM	–	–	80,0166 <sup>2</sup>
Klasse AS	11,1952 <sup>3</sup>	11,0946 <sup>3</sup>	9,1444 <sup>3</sup>
Klasse ASC	9,1249 <sup>3</sup>	9,5406 <sup>3</sup>	7,8280 <sup>3</sup>
Klasse ASH	11,0880 <sup>3</sup>	11,0586 <sup>3</sup>	8,6294 <sup>3</sup>
Klasse ASP	9,1289 <sup>3</sup>	9,4660 <sup>3</sup>	8,1919 <sup>3</sup>
Klasse AU	20,5295	20,4434	15,8709
Klasse AUM	9,7159	10,1632	8,2835
Klasse AUP	9,1953	9,6048	7,8434
Klasse DEC	7,3229 <sup>1</sup>	7,7834 <sup>1</sup>	6,4921 <sup>1</sup>
Klasse DEH	10,1960 <sup>1</sup>	10,3401 <sup>1</sup>	8,1990 <sup>1</sup>
Klasse DEP	8,8122 <sup>1</sup>	8,7797 <sup>1</sup>	7,7380 <sup>1</sup>
Klasse DU	12,6175	12,6591	9,9014
Klasse DUP	8,3429	8,7793	7,2225
Klasse ZE	12,1429 <sup>1</sup>	11,3949 <sup>1</sup>	9,4286 <sup>1</sup>
Klasse ZEC	8,5885 <sup>1</sup>	9,0180 <sup>1</sup>	7,4323 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	10,8301 <sup>1</sup>	10,8464 <sup>1</sup>	8,4917 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	10,6752 <sup>4</sup>	10,7251 <sup>4</sup>	8,4161 <sup>4</sup>
Klasse ZU	12,0281	11,9183	9,2068
Klasse ZUP	9,2576	9,6307	7,8321

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf HKD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	6.087.459
Bankguthaben	2	113.214
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		18.828
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.056
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>6.220.557</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(68.995)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.530)
Sonstige Passiva	20	(53.606)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(126.131)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>6.094.426</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	100,000
Klasse AEC	100,000
Klasse AEH	9.264,036
Klasse AU	600,000
Klasse AUP	100,000
Klasse IE	100,000
Klasse IEH	100,000
Klasse IG	100,000
Klasse IU	100,000
Klasse LE	97.000,000
Klasse LG	100,000
Klasse XU	100,000
Klasse ZE	100,000
Klasse ZEC	100,000
Klasse ZEH	100,000
Klasse ZU	498.187,100
Klasse ZUP	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021
Klasse AE	10,1300 <sup>1</sup>	13,1238 <sup>1</sup>
Klasse AEC	9,3082 <sup>1</sup>	13,0744 <sup>1</sup>
Klasse AEH	9,4264 <sup>1</sup>	13,1208 <sup>1</sup>
Klasse AU	9,6534	13,2113
Klasse AUP	9,5286	13,1684
Klasse IE	10,2725 <sup>1</sup>	13,1851 <sup>1</sup>
Klasse IEH	9,5604 <sup>1</sup>	13,1794 <sup>1</sup>
Klasse IG	9,4923 <sup>2</sup>	12,2808 <sup>2</sup>
Klasse IU	9,7979	13,2780
Klasse LE	10,3264 <sup>1</sup>	13,2092 <sup>1</sup>
Klasse LG	9,5344 <sup>2</sup>	12,2989 <sup>2</sup>
Klasse XU	9,8914	13,3214
Klasse ZE	10,2464 <sup>1</sup>	13,1739 <sup>1</sup>
Klasse ZEC	9,4153 <sup>1</sup>	13,1241 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	9,5353 <sup>1</sup>	13,1675 <sup>1</sup>
Klasse ZU	9,7613	13,2623
Klasse ZUP	9,6378	13,2192

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>9.412.889</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	66.527
Zinsen auf Bankguthaben	2	80
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>66.607</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(57.320)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(9)
Betriebskosten	3, 5	(22.726)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(80.055)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(13.448)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(574.777)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(11.857)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(6.538)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(593.172)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(1.707.710)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		3.001
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(1.704.709)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(2.311.329)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		1.668.929
Anteilrücknahmen		(2.676.017)
Dividenden	7	(46)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(1.007.134)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>6.094.426</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2022	31. März 2021
	6.094.426	9.412.889

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	2.404.351.805
Bankguthaben	2	6.925.592
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		26.866.167
Forderungen aus Zeichnungen		8.754.926
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.193.486
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.874.184
Sonstige Aktiva		505.383
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>2.450.471.543</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(41.067.316)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.707.613)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.109.417)
Sonstige Passiva		(492.782)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(45.377.128)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>2.405.094.415</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	1.477.671,395
Klasse AEP	3.074.878,953
Klasse AU	7.523.220,429
Klasse AUP	39.384,886
Klasse DEH	547.936,599
Klasse DU	1.395.157,223
Klasse IE	5.899.820,781
Klasse IEH	2.842.654,312
Klasse IU	38.509.594,525
Klasse IUP	50.445,119
Klasse W	18.021,468
Klasse XU	3.640.839,172
Klasse ZE	3.698.636,331
Klasse ZEH	93.641,491
Klasse ZEP	3.306.243,038
Klasse ZFH	101.715,000
Klasse ZG	635.440,696
Klasse ZU	2.369.130,029

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.676.310.766</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.116.419
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.666
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>12.118.085</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(23.896.758)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(3.558)
Betriebskosten	3, 5	(5.645.550)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(29.545.866)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(17.427.781)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		158.788.558
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(17.035.649)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.000.087)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>140.752.822</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(105.523.703)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		4.068.728
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(101.454.975)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>21.870.066</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		1.658.149.514
Anteilrücknahmen		(950.258.673)
Dividenden	7	(977.258)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>706.913.583</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>2.405.094.415</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	2.405.094.415	1.676.310.766	781.859.426

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	60,3566 <sup>1</sup>	57,4173 <sup>1</sup>	39,4473 <sup>1</sup>
Klasse AEP	21,3430 <sup>1</sup>	19,1012 <sup>1</sup>	13,9549 <sup>1</sup>
Klasse AU	102,8279	96,5311	65,4043
Klasse AUP	16,3197	15,4283	10,5256
Klasse DEH	43,2512 <sup>1</sup>	41,4515 <sup>1</sup>	28,6905 <sup>1</sup>
Klasse DU	53,0512	50,1776	34,2524
Klasse IE	20,7896 <sup>1</sup>	18,3198 <sup>1</sup>	13,1834 <sup>1</sup>
Klasse IEH	16,3912 <sup>1</sup>	15,4630 <sup>1</sup>	10,5330 <sup>1</sup>
Klasse IU	21,1779	19,7127	13,2437
Klasse IUP	16,8469	15,7922	10,6770
Klasse W	157,1578	147,4604	99,8614
Klasse XU	24,7993	22,8996	15,2627
Klasse ZE	23,4189 <sup>1</sup>	20,6574 <sup>1</sup>	14,8804 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	11,7932 <sup>1</sup>	11,1310 <sup>1</sup>	–
Klasse ZEP	22,1355 <sup>1</sup>	19,6580 <sup>1</sup>	14,2420 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	11,7503 <sup>2</sup>	11,1109 <sup>2</sup>	–
Klasse ZG	23,1166 <sup>3</sup>	20,5546 <sup>3</sup>	15,3810 <sup>3</sup>
Klasse ZU	25,6233	23,8745	16,0557

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	132.697.467
Bankguthaben	2	3.310.181
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		63.698
Forderungen aus Zeichnungen		101.705
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		351.271
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	22.574
Sonstige Aktiva		11.923
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>136.558.819</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(608.201)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.560)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(103.419)
Steuerverbindlichkeit	3	(587.926)
Sonstige Passiva	20	(1.149.832)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.451.938)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>134.106.881</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	12.312,883
Klasse AU	27.468,354
Klasse DEH	45.247,603
Klasse DU	65.171,226
Klasse IE	24.771,363
Klasse IEH	37.444,190
Klasse IU	6.770.592,201
Klasse XU	100,000
Klasse ZU	138.296,669
Klasse 1E	3.414.046,177
Klasse 1U	2.241.486,693
Klasse 2E	2.016.097,894
Klasse 2U	53,000
Klasse 8E	3.214.240,535
Klasse 8U	1.625.502,942

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	29,8455 <sup>1</sup>	42,3802 <sup>1</sup>	23,6114 <sup>1</sup>
Klasse AU	48,9816	68,3931	37,5590
Klasse DEH	21,1131 <sup>1</sup>	30,1969 <sup>1</sup>	16,9558 <sup>1</sup>
Klasse DU	34,0169	47,8562	26,4784
Klasse IE	11,8421 <sup>1</sup>	15,5210 <sup>1</sup>	–
Klasse IEH	18,1198 <sup>1</sup>	25,5028 <sup>1</sup>	14,0970 <sup>1</sup>
Klasse IU	11,7660	16,2895	8,8704
Klasse XU <sup>#</sup>	10,2512	–	–
Klasse ZU	11,2539	15,5962	8,5014
Klasse 1E	1,4248 <sup>1</sup>	1,8817 <sup>1</sup>	1,1059 <sup>1</sup>
Klasse 1U	1,5851	2,2113	1,2133
Klasse 2E	13,0947 <sup>1</sup>	17,1886 <sup>1</sup>	10,0408 <sup>1</sup>
Klasse 2U	12,8579	17,8242	9,7175
Klasse 8E	1,5656 <sup>1</sup>	2,0559 <sup>1</sup>	1,2015 <sup>1</sup>
Klasse 8U	1,7421	2,4165	1,3184

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>#</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>170.104.097</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.555.711
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.447
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.557.158</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.576.846)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(369)
Ausländische Steuern	3	(49.654)
Betriebskosten	3, 5	(304.326)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(1.931.195)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(374.037)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(4.793.522)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(306.345)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(1.482)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(5.101.349)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(46.613.739)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		77.524
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(46.536.215)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(52.011.601)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		33.123.322
Anteilrücknahmen		(17.108.937)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>16.014.385</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>134.106.881</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	134.106.881	170.104.097	79.154.413

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	214.560.597
Bankguthaben	2	1.007.770
Forderungen aus Zeichnungen		173.185
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		607.433
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	46.258
Sonstige Aktiva		82.033
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>216.477.276</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(203.475)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(148.373)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(175.301)
Sonstige Passiva		(31.414)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(558.563)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>215.918.713</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	4.826,000
Klasse AUP	84,000
Klasse DEC	77,000
Klasse DUP	49.298,838
Klasse IU	1.696.964,000
Klasse TE	66,000
Klasse ZU	75,000
Klasse 1E	1.711.851,263
Klasse 1EP	1.456.672,606
Klasse 1SC	448.331,157
Klasse 1SH	46.927,167
Klasse 1ST	57.134,593
Klasse 1U	332.643,826
Klasse 1UP	414.444,366
Klasse 1VT	8.209,275
Klasse 2E	758.317,796
Klasse 2EP	72,000
Klasse 2U	75,000
Klasse 2UP	82,000
Klasse 3E	168.288,744
Klasse 3EP	8.253.236,205
Klasse 3U	17.230,767
Klasse 3UP	39.425,389
Klasse 8E	121.882,621
Klasse 8EP	237,977
Klasse 8U	13.233,578
Klasse 8UP	57.981,704
Klasse 9E	16.536,344
Klasse 9EP	72,000
Klasse 9U	74,000
Klasse 9UP	82,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>220.612.038</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.019.124
Zinsen auf Bankguthaben	2	383
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>5.019.507</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.181.903)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(606)
Betriebskosten	3, 5	(381.951)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.564.460)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.455.047</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		21.812.732
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(88.378)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		16.877
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>21.741.231</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(13.634.521)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		38.151
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(13.596.370)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>10.599.908</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		50.057.803
Anteilrücknahmen		(61.017.036)
Dividenden	7	(4.334.000)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(15.293.233)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>215.918.713</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	215.918.713	220.612.038	302.458.662

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	10,9032 <sup>1</sup>	10,8646 <sup>1</sup>	7,7949 <sup>1</sup>
Klasse AUP	11,7207	11,5197	8,1529
Klasse DEC	10,7205 <sup>1</sup>	10,7367 <sup>1</sup>	7,7468 <sup>1</sup>
Klasse DUP	11,5104	11,3689	8,0829
Klasse IU	13,5078	12,8194	8,7152
Klasse TE	13,8508 <sup>1</sup>	12,4675 <sup>1</sup>	9,0928 <sup>1</sup>
Klasse ZU	13,4839	12,8038	8,7095
Klasse 1E	13,6005 <sup>1</sup>	12,3011 <sup>1</sup>	9,0161 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	12,1468 <sup>1</sup>	11,2887 <sup>1</sup>	8,5463 <sup>1</sup>
Klasse 1SC	11,4630 <sup>2</sup>	11,2960 <sup>2</sup>	8,0406 <sup>2</sup>
Klasse 1SH	12,8545 <sup>2</sup>	12,3246 <sup>2</sup>	8,4957 <sup>2</sup>
Klasse 1ST	11,4849 <sup>2</sup>	11,3150 <sup>2</sup>	8,0568 <sup>2</sup>
Klasse 1U	13,2084	12,6191	8,6349
Klasse 1UP	11,7772	11,5601	8,1749
Klasse 1VT	11,1290 <sup>3</sup>	11,0336 <sup>3</sup>	7,9347 <sup>3</sup>
Klasse 2E	14,1440 <sup>1</sup>	12,7149 <sup>1</sup>	9,2630 <sup>1</sup>
Klasse 2EP	12,4187 <sup>1</sup>	11,4725 <sup>1</sup>	8,6258 <sup>1</sup>
Klasse 2U	13,4831	12,8080	8,7103
Klasse 2UP	12,0644	11,7699	8,2624
Klasse 3E	13,9552 <sup>1</sup>	12,5276 <sup>1</sup>	9,1138 <sup>1</sup>
Klasse 3EP	12,4603 <sup>1</sup>	11,4904 <sup>1</sup>	8,6418 <sup>1</sup>
Klasse 3U	13,5528	12,8514	8,7285
Klasse 3UP	12,1163	11,8020	8,2797
Klasse 8E	13,8635 <sup>1</sup>	12,4677 <sup>1</sup>	9,0865 <sup>1</sup>
Klasse 8EP	12,3593 <sup>1</sup>	11,4170 <sup>1</sup>	8,5947 <sup>1</sup>
Klasse 8U	13,4674	12,7934	8,7047
Klasse 8UP	12,0275	11,7367	8,2462
Klasse 9E	13,9945 <sup>1</sup>	12,5555 <sup>1</sup>	9,1275 <sup>1</sup>
Klasse 9EP	12,4988 <sup>1</sup>	11,5171 <sup>1</sup>	8,6420 <sup>1</sup>
Klasse 9U	13,6064	12,8935	8,7456
Klasse 9UP	12,1372	11,8108	8,2711

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf AUD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	592.254.382
Bankguthaben	2	3.753.594
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		6.999.102
Forderungen aus Zeichnungen		5.664.048
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.144.345
Sonstige Aktiva		157.754
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>609.973.225</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(73.573)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(656.436)
Sonstige Passiva		(79.654)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(809.663)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>609.163.562</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IU	66.837,831
Klasse ZU	1.378,995
Klasse 1E	25.948.688,749
Klasse 1U	70.305.963,273
Klasse 2E	53,000
Klasse 2U	229.045,849
Klasse 3U	7.105.719,536
Klasse 8E	83.261,592
Klasse 8U	20.688.020,702
Klasse 9U	1.566.267,050

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse IU	15,7040	15,4100	10,4063
Klasse ZU	15,6678	15,3846	10,3985
Klasse 1E	3,8796 <sup>1</sup>	3,6305 <sup>1</sup>	2,6451 <sup>1</sup>
Klasse 1U	4,3160	4,2662	2,9019
Klasse 2E	16,0460 <sup>1</sup>	14,9212 <sup>1</sup>	10,8024 <sup>1</sup>
Klasse 2U	15,6533	15,3787	10,3974
Klasse 3U	4,6059	4,5175	3,0491
Klasse 8E	5,6972 <sup>1</sup>	5,3010 <sup>1</sup>	3,8404 <sup>1</sup>
Klasse 8U	6,3379	6,2292	4,2132
Klasse 9U	15,7566	15,4477	10,4222

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>605.915.496</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.373.466
Zinsen auf Bankguthaben	2	547
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>5.374.013</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(8.439.459)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(727)
Betriebskosten	3, 5	(1.013.683)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(9.453.869)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(4.079.856)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		63.256.075
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(900)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		161.247
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>63.416.422</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(52.800.069)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		230
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(52.799.839)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>6.536.727</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		144.895.359
Anteilrücknahmen		(148.184.020)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(3.288.661)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>609.163.562</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	609.163.562	605.915.496	365.150.642

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.877.091.618
Bankguthaben	2	3.222.465
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		23.111.308
Forderungen aus Zeichnungen		7.297.960
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.066.315
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	283.806
Sonstige Aktiva		216.825
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.913.290.297</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(15.957.105)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.412.099)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.789.105)
Sonstige Passiva		(413.804)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(20.572.113)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.892.718.184</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	15.240.273,036
Klasse AEP	18.987.567,259
Klasse AK	1.178.978,335
Klasse AUP	74.083,248
Klasse DE	1.629.789,153
Klasse IE	6.655.119,670
Klasse IEP	2.631.535,479
Klasse NE	5.944.183,000
Klasse XE	1.529.301,228
Klasse XFH	78,000
Klasse XG	41,000
Klasse XGH	30,000
Klasse XU	5.717.517,656
Klasse ZE	3.278.110,407
Klasse ZFH	2.159.595,023
Klasse ZG	1.141.692,065
Klasse ZGH	76.250,526
Klasse ZU	5.985.199,343

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>2.108.588.124</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	12.107.842
Zinsen auf Bankguthaben	2	901
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>12.108.743</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(21.988.536)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(9.126)
Betriebskosten	3, 5	(5.209.945)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(27.207.607)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(15.098.864)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		216.602.513
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.510.905
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		1.101.825
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>219.215.243</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(295.458.887)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		251.045
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(295.207.842)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(91.091.463)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		1.070.664.332
Anteilrücknahmen		(1.193.047.824)
Dividenden	7	(2.394.985)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(124.778.477)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.892.718.184</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	1.892.718.184	2.108.588.124	467.243.010

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	45,6690	47,2890	28,8263
Klasse AEP	14,9359	15,5848	9,5558
Klasse AK	123,9807 <sup>1</sup>	126,8311 <sup>1</sup>	82,0449 <sup>1</sup>
Klasse AUP	14,1101 <sup>2</sup>	15,5516 <sup>2</sup>	8,9026 <sup>2</sup>
Klasse DE	34,6525	36,0617	22,0920
Klasse IE	66,7097	68,4913	41,3989
Klasse IEP	12,6727	13,1106	–
Klasse NE	14,6609	15,0223	9,0621
Klasse XE	17,0020	17,3169	10,3840
Klasse XFH	11,2077 <sup>3</sup>	11,4338 <sup>3</sup>	–
Klasse XG	16,3517 <sup>4</sup>	16,7790 <sup>4</sup>	10,4565 <sup>4</sup>
Klasse XGH	23,1206 <sup>4</sup>	23,4350 <sup>4</sup>	14,0424 <sup>4</sup>
Klasse XU	10,5772 <sup>2</sup>	11,3797 <sup>2</sup>	–
Klasse ZE	16,4090	16,8641	10,2035
Klasse ZFH	16,1495 <sup>3</sup>	16,6452 <sup>3</sup>	10,1002 <sup>3</sup>
Klasse ZG	15,8031 <sup>4</sup>	16,3719 <sup>4</sup>	10,2901 <sup>4</sup>
Klasse ZGH	47,7950 <sup>4</sup>	48,9276 <sup>4</sup>	29,5931 <sup>4</sup>
Klasse ZU	15,4806 <sup>2</sup>	16,8058 <sup>2</sup>	9,4930 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - American

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.233.305.410
Bankguthaben	2	3.847.642
Forderungen aus Zeichnungen		3.267.191
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		833.684
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.894.412
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.243.148.339</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(474.975)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.057.603)
Sonstige Passiva		(198.184)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.730.762)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.241.417.577</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	1.502.751,217
Klasse AU	292.740,609
Klasse DEH	48.750,188
Klasse DU	582.533,656
Klasse IEH	436.245,326
Klasse IU	6.763.199,353
Klasse W	1.598,035
Klasse ZE	52,000
Klasse ZEH	1.561.051,905
Klasse ZU	60,000
Klasse 1E	2.698.411,157
Klasse 1EH	185.644,732
Klasse 1EP	309.785,190
Klasse 1U	12.462.435,100
Klasse 2E	745.901,784
Klasse 2U	5.344.860,837
Klasse 3EH	45.378,315
Klasse 3U	189.130,202
Klasse 8E	1.632.956,392
Klasse 8U	2.567.454,782
Klasse 9EH	55,000
Klasse 9U	325.296,350

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.120.251.631</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	10.327.147
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.082
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>10.328.229</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(12.654.988)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(118)
Betriebskosten	3, 5	(2.285.762)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(14.940.868)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(4.612.639)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		209.569.433
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(15.065.206)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		3.757
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>194.507.984</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(92.091.530)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		4.026.321
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(88.065.209)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>101.830.136</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		275.919.659
Anteilrücknahmen		(256.517.711)
Dividenden	7	(66.138)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>19.335.810</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.241.417.577</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	1.241.417.577	1.120.251.631	845.435.297

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	67,7231 <sup>1</sup>	62,4805 <sup>1</sup>	39,8500 <sup>1</sup>
Klasse AU	118,2788	107,7058	67,7834
Klasse DEH	49,9448 <sup>1</sup>	46,2355 <sup>1</sup>	29,5927 <sup>1</sup>
Klasse DU	45,8481	41,8962	26,4589
Klasse IEH	73,6686 <sup>1</sup>	67,3710 <sup>1</sup>	42,5805 <sup>1</sup>
Klasse IU	81,4356	73,4915	45,8385
Klasse W	157,8424	143,3024	89,9169
Klasse ZE	17,7345 <sup>1</sup>	15,1672 <sup>1</sup>	10,1443 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	15,6669 <sup>1</sup>	14,3367 <sup>1</sup>	9,0706 <sup>1</sup>
Klasse ZU	17,0528	15,4031	9,6205
Klasse 1E	16,9814 <sup>1</sup>	14,6201 <sup>1</sup>	9,8427 <sup>1</sup>
Klasse 1EH	15,2219 <sup>1</sup>	14,0242 <sup>1</sup>	8,9324 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	16,1234 <sup>1</sup>	14,0455 <sup>1</sup>	9,5797 <sup>1</sup>
Klasse 1U	16,3179	14,8399	9,3272
Klasse 2E	17,3483 <sup>1</sup>	14,8451 <sup>1</sup>	9,9337 <sup>1</sup>
Klasse 2U	16,6678	15,0659	9,4120
Klasse 3EH	15,6415 <sup>1</sup>	14,2960 <sup>1</sup>	9,0365 <sup>1</sup>
Klasse 3U	16,7719	15,1327	9,4368
Klasse 8E	17,3225 <sup>1</sup>	14,8290 <sup>1</sup>	9,9269 <sup>1</sup>
Klasse 8U	16,6398	15,0466	9,4037
Klasse 9EH	15,6785 <sup>1</sup>	14,3200 <sup>1</sup>	9,0418 <sup>1</sup>
Klasse 9U	16,7881	15,1413	9,4383

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	406.006.373
Bankguthaben	2	8.809.492
Forderungen aus Zeichnungen		69.573
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		241.187
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	24.480
Sonstige Aktiva		188
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>415.151.293</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(486.252)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(417.492)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(501.597)
Sonstige Passiva		(57.932)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.463.273)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>413.688.020</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AD	405,000
Klasse AEH	18.379,716
Klasse AN	524,000
Klasse AU	140.489,621
Klasse DEH	11.494,640
Klasse DU	99.029,031
Klasse ID	399,000
Klasse IE	54,000
Klasse IEH	12.549,933
Klasse IN	517,000
Klasse W	4.870,367
Klasse ZEH	53,000
Klasse ZU	5.988,946
Klasse 1E	12.684.226,950
Klasse 1EH	76.418,179
Klasse 1EP	392.323,835
Klasse 1U	40.558.822,737
Klasse 2EH	712,000
Klasse 2U	3.119,818
Klasse 3E	1.339.364,838
Klasse 3U	955.639,839
Klasse 8EH	4.562,812
Klasse 8U	2.553.512,444
Klasse 9E	50,000
Klasse 9U	2.418,367

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>438.535.319</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.242.008
Zinsen auf Bankguthaben	2	2.234
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.244.242</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.487.243)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(392)
Betriebskosten	3, 5	(756.643)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(7.244.278)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(4.000.036)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		156.102.766
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(235.516)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(762)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>155.866.488</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(111.432.503)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		76.175
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(111.356.328)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>40.510.124</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		33.389.025
Anteilrücknahmen		(98.718.086)
Dividenden	7	(28.362)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(65.357.423)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>413.688.020</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	413.688.020	438.535.319	315.353.771

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AD	16,1001 <sup>1</sup>	14,0643 <sup>1</sup>	9,5986 <sup>1</sup>
Klasse AEH	43,2612 <sup>2</sup>	40,4315 <sup>2</sup>	26,0234 <sup>2</sup>
Klasse AN	16,2724 <sup>3</sup>	14,6605 <sup>3</sup>	11,4489 <sup>3</sup>
Klasse AU	39,9888	36,9044	23,4327
Klasse DEH	29,3649 <sup>2</sup>	27,6535 <sup>2</sup>	17,9318 <sup>2</sup>
Klasse DU	34,9947	32,5387	20,8155
Klasse ID	16,4501 <sup>1</sup>	14,2588 <sup>1</sup>	9,6523 <sup>1</sup>
Klasse IE	16,5155 <sup>2</sup>	14,3186 <sup>2</sup>	9,6644 <sup>2</sup>
Klasse IEH	46,2659 <sup>2</sup>	42,8992 <sup>2</sup>	27,3895 <sup>2</sup>
Klasse IN	16,6107 <sup>3</sup>	14,8493 <sup>3</sup>	11,5094 <sup>3</sup>
Klasse W	42,3137	39,0305	24,7704
Klasse ZEH	15,5785 <sup>2</sup>	14,4664 <sup>2</sup>	9,2429 <sup>2</sup>
Klasse ZU	16,9458	15,5296	9,7922
Klasse 1E	6,1787 <sup>2</sup>	5,3911 <sup>2</sup>	3,6619 <sup>2</sup>
Klasse 1EH	4,5896 <sup>2</sup>	4,2840 <sup>2</sup>	2,7534 <sup>2</sup>
Klasse 1EP	5,9576 <sup>2</sup>	5,2548 <sup>2</sup>	3,5938 <sup>2</sup>
Klasse 1U	6,8745	6,3360	4,0179
Klasse 2EH	16,1111 <sup>2</sup>	14,9450 <sup>2</sup>	9,5434 <sup>2</sup>
Klasse 2U	17,2032	15,7585	9,9304
Klasse 3E	5,0705 <sup>2</sup>	4,3890 <sup>2</sup>	2,9575 <sup>2</sup>
Klasse 3U	5,6415	5,1582	3,2451
Klasse 8EH	4,0452 <sup>2</sup>	3,7559 <sup>2</sup>	2,4004 <sup>2</sup>
Klasse 8U	7,9480	7,2838	4,5928
Klasse 9E	17,7121 <sup>2</sup>	15,3150 <sup>2</sup>	10,3117 <sup>2</sup>
Klasse 9U	17,3500	15,8570	9,9683

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf DKK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	334.512.584
Bankguthaben	2	1.797.188
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		171.596
Forderungen aus Zeichnungen		238.521
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		28.296
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	158.026
Sonstige Aktiva		213
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>336.906.424</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(164.934)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(329.365)
Sonstige Passiva		(46.767)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(541.066)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>336.365.358</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	140.088,752
Klasse AU	29.665,968
Klasse DEH	25.620,198
Klasse DU	63.591,422
Klasse IE	1.204.957,367
Klasse IU	649.471,862
Klasse ZU	8.531,509
Klasse 1E	640.959,194
Klasse 1EP	1.024.064,250
Klasse 1U	6.728.679,099
Klasse 2U	1.591.530,857
Klasse 3EH	576.674,863
Klasse 3U	1.048.042,443
Klasse 8U	1.285.290,649
Klasse 9EH	35.041,179
Klasse 9U	3.273.503,110

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	16,5581 <sup>1</sup>	16,6368 <sup>1</sup>	8,2252 <sup>1</sup>
Klasse AU	17,7793	17,6124	8,5873
Klasse DEH	16,2757 <sup>1</sup>	16,4357 <sup>1</sup>	8,1660 <sup>1</sup>
Klasse DU	17,4841	17,4069	8,5270
Klasse IE	17,1002 <sup>1</sup>	15,9009 <sup>1</sup>	8,2360 <sup>1</sup>
Klasse IU	18,3099	17,9845	8,6950
Klasse ZU	18,2631	17,9572	8,6865
Klasse 1E	18,4235 <sup>1</sup>	17,2570 <sup>1</sup>	8,9994 <sup>1</sup>
Klasse 1EP	17,4744 <sup>1</sup>	16,5639 <sup>1</sup>	8,7169 <sup>1</sup>
Klasse 1U	17,8692	17,6803	8,6079
Klasse 2U	18,2483	17,9455	8,6842
Klasse 3EH	17,0721 <sup>1</sup>	17,0018 <sup>1</sup>	8,3303 <sup>1</sup>
Klasse 3U	18,3319	18,0025	8,6996
Klasse 8U	18,2318	17,9365	8,6833
Klasse 9EH	17,1199 <sup>1</sup>	17,0449 <sup>1</sup>	8,3502 <sup>1</sup>
Klasse 9U	18,3630	18,0258	8,7074

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>317.052.344</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.876.072
Zinsen auf Bankguthaben	2	596
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.876.668</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(4.024.509)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(53)
Betriebskosten	3, 5	(554.391)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.578.953)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.702.285)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		43.364.588
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(1.119.296)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		8.651
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>42.253.943</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(37.199.775)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		173.761
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(37.026.014)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.525.644</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		140.996.526
Anteilrücknahmen		(124.970.358)
Dividenden	7	(238.798)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>15.787.370</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>336.365.358</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	336.365.358	317.052.344	172.396.358

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	95.320.024
Bankguthaben	2	1.724.758
Forderungen aus Zeichnungen		1.188.438
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		338.964
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	3.161
Sonstige Aktiva		17.111
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>98.592.456</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(1.287.208)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.994)
Steuerverbindlichkeit	3	(259.959)
Sonstige Passiva	20	(1.427.289)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.978.450)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>95.614.006</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.735,856
Klasse AF	51,000
Klasse AS	857,690
Klasse ASH	33.786,135
Klasse AU	259.450,496
Klasse DE	24.615,097
Klasse IF	49,000
Klasse ISH	71,000
Klasse IU	2.098,250
Klasse XU	4.637.251,800
Klasse XUP	2.557.578,913
Klasse ZE	45,000
Klasse ZEH	49,000
Klasse ZF	49,000
Klasse ZG	60,000
Klasse ZU	4.199,804

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	15,4485 <sup>1</sup>	18,3066 <sup>1</sup>	11,6808 <sup>1</sup>
Klasse AF	14,5713 <sup>2</sup>	18,6638 <sup>2</sup>	11,4321 <sup>2</sup>
Klasse AS	11,4961 <sup>3</sup>	14,2865 <sup>3</sup>	9,0235 <sup>3</sup>
Klasse ASH	14,2590 <sup>3</sup>	17,9279 <sup>3</sup>	10,7767 <sup>3</sup>
Klasse AU	15,0003	18,7762	11,1870
Klasse DE	14,6194 <sup>1</sup>	17,4547 <sup>1</sup>	11,2228 <sup>1</sup>
Klasse IF	15,3389 <sup>2</sup>	19,4667 <sup>2</sup>	11,8248 <sup>2</sup>
Klasse ISH	15,2033 <sup>3</sup>	18,9488 <sup>3</sup>	11,2943 <sup>3</sup>
Klasse IU	15,9526	19,7990	11,6971
Klasse XU	12,1685	14,9820	8,7810
Klasse XUP	13,4480	16,9577	10,1785
Klasse ZE	16,2137 <sup>1</sup>	19,0713 <sup>1</sup>	12,0806 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	13,8883 <sup>1</sup>	17,5088 <sup>1</sup>	10,5075 <sup>1</sup>
Klasse ZF	15,3088 <sup>2</sup>	19,4570 <sup>2</sup>	11,8269 <sup>2</sup>
Klasse ZG	10,2500 <sup>4</sup>	12,1521 <sup>4</sup>	7,9962 <sup>4</sup>
Klasse ZU	15,8950	19,7473	11,6781

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>188.088.458</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.644.345
Zinsen auf Bankguthaben	2	329
Andere Erträge		108.485
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.753.159</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(60.597)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(49)
Betriebskosten	3, 5	(203.344)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(263.990)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.489.169</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		14.934.251
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(13.053)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(48.235)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>14.872.963</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(42.662.660)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		11.408
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(42.651.252)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(25.289.120)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		22.833.437
Anteilrücknahmen		(88.801.010)
Dividenden	7	(1.217.759)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(67.185.332)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>95.614.006</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	95.614.006	188.088.458	124.384.661

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	144.400.621
Bankguthaben	2	2.419.586
Forderungen aus Zeichnungen		32.223
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		332.057
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	16
Sonstige Aktiva		32.005
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>147.216.508</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(2.057.217)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(31.388)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(154.380)
Steuerverbindlichkeit	3	(518.672)
Sonstige Passiva	20	(2.073.873)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(4.835.530)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>142.380.978</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	83,000
Klasse AEH	83,000
Klasse DE	83,000
Klasse DEH	83,000
Klasse IE	453.731,789
Klasse IU	172.488,901
Klasse ZU	19.857,424
Klasse 1E	1.410.663,064
Klasse 1U	23.971.662,820
Klasse 2E	55,000
Klasse 2U	1.631.669,711
Klasse 3U	4.551.379,745
Klasse 8E	676,483
Klasse 8U	1.554.803,944
Klasse 9U	8.216,061

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE <sup>1</sup>	8,9696 <sup>1</sup>	—	—
Klasse AEH <sup>1</sup>	8,0913 <sup>1</sup>	—	—
Klasse DE <sup>1</sup>	8,9361 <sup>1</sup>	—	—
Klasse DEH <sup>1</sup>	8,0618 <sup>1</sup>	—	—
Klasse IE	12,8045 <sup>1</sup>	14,5096 <sup>1</sup>	9,0252 <sup>1</sup>
Klasse IU	13,3897	16,0271	9,3071
Klasse ZU	13,3540	16,0024	9,3012
Klasse 1E	3,2041 <sup>1</sup>	3,6581 <sup>1</sup>	2,2925 <sup>1</sup>
Klasse 1U	3,5648	4,2991	2,5152
Klasse 2E	13,6717 <sup>1</sup>	15,5085 <sup>1</sup>	9,6601 <sup>1</sup>
Klasse 2U	13,3414	15,9916	9,2995
Klasse 3U	3,2148	3,8480	2,2346
Klasse 8E	3,6646 <sup>1</sup>	4,1593 <sup>1</sup>	2,5930 <sup>1</sup>
Klasse 8U	4,0790	4,8912	2,8455
Klasse 9U	13,4178	16,0542	9,3192

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>343.930.526</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.354.187
Zinsen auf Bankguthaben	2	369
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>5.354.556</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.281.756)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(330)
Ausländische Steuern	3	(62.940)
Betriebskosten	3, 5	(408.329)
Sonstige Gebühren	4	(11)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.753.366)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.601.190</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		43.121.982
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(243)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(495.257)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>42.626.482</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(92.367.691)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		16
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(92.367.675)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(48.140.003)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		77.479.320
Anteilrücknahmen		(230.888.865)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(153.409.545)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>142.380.978</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	142.380.978	343.930.526	195.909.991

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	370.623.854
Bankguthaben	2	7.069.308
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		1.250.885
Forderungen aus Zeichnungen		129.415
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		204.789
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.064.274
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>380.342.525</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(769.612)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(247.047)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(179.502)
Sonstige Passiva		(77.347)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.273.508)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>379.069.017</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEC	339,290
Klasse AEH	21.509,877
Klasse AU	77.410,274
Klasse AUP	9.499,092
Klasse DU	7.929,831
Klasse IU	2.101.415,251
Klasse XS	69,000
Klasse XSH	7.079.213,360
Klasse ZEH	338.268,660
Klasse ZFH	48,000
Klasse ZGH	35,000
Klasse ZU	3.546.486,328

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEC	18,8839 <sup>1</sup>	17,5161 <sup>1</sup>	11,3591 <sup>1</sup>
Klasse AEH	31,2589 <sup>1</sup>	28,6186 <sup>1</sup>	18,3280 <sup>1</sup>
Klasse AU	57,7098	52,1802	32,9720
Klasse AUP	20,8998	19,1464	12,2618
Klasse DU	28,6587	26,0427	16,5381
Klasse IU	83,5904	74,9789	47,0024
Klasse XS	20,4221 <sup>2</sup>	18,0154 <sup>2</sup>	11,8570 <sup>2</sup>
Klasse XSH	20,6253 <sup>2</sup>	18,3848 <sup>2</sup>	11,4988 <sup>2</sup>
Klasse ZEH	20,4263 <sup>3</sup>	18,5596 <sup>3</sup>	11,8015 <sup>3</sup>
Klasse ZFH	19,9729 <sup>3</sup>	18,1775 <sup>3</sup>	11,5719 <sup>3</sup>
Klasse ZGH	21,2839 <sup>4</sup>	19,2281 <sup>4</sup>	12,2135 <sup>4</sup>
Klasse ZU	23,1731	20,7962	13,0432

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>484.292.226</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	4.491.304
Zinsen auf Bankguthaben	2	2.301
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>4.493.605</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.032.540)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(88)
Betriebskosten	3, 5	(1.213.281)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(4.245.909)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>247.696</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		99.783.973
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.596.655)
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		6.854
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>97.194.172</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(46.629.273)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.029.713
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(45.599.560)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>51.842.308</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		75.414.402
Anteilrücknahmen		(232.477.048)
Dividenden	7	(2.871)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(157.065.517)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>379.069.017</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	379.069.017	484.292.226	462.376.758

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	78.078.137
Bankguthaben	2	969.724
Forderungen aus Zeichnungen		94.415
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		41.686
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	8.256
Sonstige Aktiva		998
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>79.193.216</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(513.814)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(5.614)
Sonstige Passiva		(6.548)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(525.976)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>78.667.240</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	1.819,435
Klasse AEH	54,100
Klasse AU	59,094
Klasse AUP	63,640
Klasse DE	14.551,531
Klasse DEH	38.328,105
Klasse DU	917,649
Klasse IE	10.594,394
Klasse IEC	58,100
Klasse IEH	54,100
Klasse IFH	59,100
Klasse IG	18.962,461
Klasse IU	57,576
Klasse NE	65,000
Klasse NG	3.280.184,537
Klasse NU	68.874,000
Klasse XG	886.059,000
Klasse ZEH	54,100
Klasse ZFH	60,100
Klasse ZU	755,717

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>26.554.871</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	891.842
Zinsen auf Bankguthaben	2	36
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>891.878</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(61.538)
Betriebskosten	3, 5	(69.775)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(131.313)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>760.565</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.282.766
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(32.838)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(39.688)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.210.240</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		5.297.502
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		8.487
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>5.305.989</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>7.276.794</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		56.550.113
Anteilrücknahmen		(11.714.462)
Dividenden	7	(76)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>44.835.575</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>78.667.240</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	78.667.240	26.554.871	5.455.757

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	18,2898 <sup>1</sup>	15,2404 <sup>1</sup>	10,9422 <sup>1</sup>
Klasse AEH	16,4623 <sup>1</sup>	14,6709 <sup>1</sup>	9,9686 <sup>1</sup>
Klasse AU	18,2540	16,0663	10,7691
Klasse AUP	16,5908	14,8613	10,1509
Klasse DE	18,1073 <sup>1</sup>	15,1186 <sup>1</sup>	10,8764 <sup>1</sup>
Klasse DEH	16,3108 <sup>1</sup>	14,5633 <sup>1</sup>	9,9148 <sup>1</sup>
Klasse DU	18,0794	15,9450	10,7091
Klasse IE	18,5659 <sup>1</sup>	15,4165 <sup>1</sup>	11,0332 <sup>1</sup>
Klasse IEC	15,1809 <sup>1</sup>	13,7286 <sup>1</sup>	9,4747 <sup>1</sup>
Klasse IEH	16,7198 <sup>1</sup>	14,8479 <sup>1</sup>	10,0566 <sup>1</sup>
Klasse IFH	16,5489 <sup>2</sup>	14,7157 <sup>2</sup>	9,9810 <sup>2</sup>
Klasse IG	14,8037 <sup>3</sup>	12,3891 <sup>3</sup>	9,2032 <sup>3</sup>
Klasse IU	18,5671	16,2814	10,8750
Klasse NE	14,9581 <sup>1</sup>	12,3904 <sup>1</sup>	–
Klasse NG	13,8493 <sup>3</sup>	11,5750 <sup>3</sup>	–
Klasse NU	14,0857	12,3331	–
Klasse XG	13,9108 <sup>3</sup>	11,6147 <sup>3</sup>	–
Klasse ZEH	16,6597 <sup>1</sup>	14,8103 <sup>1</sup>	10,0367 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	16,4549 <sup>2</sup>	14,6448 <sup>2</sup>	9,9435 <sup>2</sup>
Klasse ZU	18,4729	16,2192	10,8446

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	470.198.593
Bankguthaben	2	3.029.049
Forderungen aus Zeichnungen		499.876
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.360.886
Sonstige Aktiva		521.522
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>475.609.926</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(130.578)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(13.825)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(262.573)
Sonstige Passiva		(57.766)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(464.742)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>475.145.184</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	149.800,138
Klasse ASH	350.628,150
Klasse AUH	8.273,433
Klasse DE	160.199,669
Klasse IE	2.820.505,413
Klasse W	30.997,242
Klasse XE	1.490.998,743
Klasse ZE	400.244,742
Klasse ZUH	2.325,637
Klasse 1E	3.106.721,280
Klasse 1EP	65,000
Klasse 1G	167.406,283
Klasse 1GP	59,000
Klasse 2E	7.442.673,214
Klasse 2G	483.687,752
Klasse 2U	73,000
Klasse 3E	403.975,888
Klasse 3G	253.272,292
Klasse 3GP	373,964
Klasse 4E	663.946,597
Klasse 4G	55,000
Klasse 8E	250.019,854
Klasse 8G	36.980,246
Klasse 8U	73,000
Klasse 9E	62,000
Klasse 9G	56,000
Klasse 9GP	57,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>386.572.137</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	10.306.835
Zinsen auf Bankguthaben	2	3.203
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>10.310.038</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(3.135.338)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(15.727)
Betriebskosten	3, 5	(645.497)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.796.562)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>6.513.476</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		16.098.564
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		443.624
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		115.415
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		8
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>16.657.611</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		1.447.436
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(71.664)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>1.375.772</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>24.546.859</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		160.966.833
Anteilrücknahmen		(96.940.436)
Dividenden	7	(209)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>64.026.188</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>475.145.184</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	475.145.184	386.572.137	169.655.099

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	83,5781	78,4220	55,8171
Klasse ASH	24,0735 <sup>1</sup>	22,3960 <sup>1</sup>	15,8502 <sup>1</sup>
Klasse AUH	28,9294 <sup>2</sup>	26,8262 <sup>2</sup>	18,8909 <sup>2</sup>
Klasse DE	30,1163	28,3149	20,2086
Klasse IE	59,3341	55,2576	39,0176
Klasse W	70,0340	65,8450	46,8999
Klasse XE	69,2730	64,0957	44,9324
Klasse ZE <sup>f</sup>	9,8259	–	–
Klasse ZUH	18,9486 <sup>2</sup>	17,4726 <sup>2</sup>	12,2253 <sup>2</sup>
Klasse 1E	13,3070	12,4836	8,8812
Klasse 1EP	12,6891	12,2262	8,8718
Klasse 1G	12,4978 <sup>3</sup>	11,8186 <sup>3</sup>	8,7345 <sup>3</sup>
Klasse 1GP	11,9244 <sup>3</sup>	11,5799 <sup>3</sup>	8,7278 <sup>3</sup>
Klasse 2E	13,5821	12,6844	8,9747
Klasse 2G	12,7552 <sup>3</sup>	12,0079 <sup>3</sup>	8,8258 <sup>3</sup>
Klasse 2U	12,9544 <sup>2</sup>	12,7712 <sup>2</sup>	8,4323 <sup>2</sup>
Klasse 3E	13,6488	12,7289	8,9937
Klasse 3G	12,8183 <sup>3</sup>	12,0504 <sup>3</sup>	8,8448 <sup>3</sup>
Klasse 3GP	12,2439 <sup>3</sup>	11,8079 <sup>3</sup>	8,8385 <sup>3</sup>
Klasse 4E	14,0773	13,0161	9,1182
Klasse 4G	13,2403 <sup>3</sup>	12,3357 <sup>3</sup>	8,9746 <sup>3</sup>
Klasse 8E	13,5570	12,6660	8,9653
Klasse 8G	12,7375 <sup>3</sup>	11,9961 <sup>3</sup>	8,8207 <sup>3</sup>
Klasse 8U	12,9310 <sup>2</sup>	12,7491 <sup>2</sup>	8,4188 <sup>2</sup>
Klasse 9E	13,7069	12,7770	9,0171
Klasse 9G	12,8673 <sup>3</sup>	12,0896 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>
Klasse 9GP	12,3004 <sup>3</sup>	11,8602 <sup>3</sup>	8,8664 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>f</sup>Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	60.188.439
Bankguthaben	2	177.650
Forderungen aus Zeichnungen		184.444
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		325.927
Sonstige Aktiva		225.114
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>61.101.574</b>
<b>Passiva</b>		
Überziehungskredite		(75.924)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(47.348)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(45.759)
Sonstige Passiva		(7.508)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(176.539)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>60.925.035</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	412,301
Klasse AEP	27.104,892
Klasse AUP	80,000
Klasse DE	4.762,182
Klasse DEP	5.262,133
Klasse IE	397.178,548
Klasse IEP	853.397,000
Klasse ZE	35.002,221
Klasse ZEP	22.802,000
Klasse 1E	4.143.033,310
Klasse 1EP	10.859.585,399
Klasse 1G	178.505,501
Klasse 1GP	353.190,637
Klasse 2E	974.334,004
Klasse 2EP	72,000
Klasse 2G	58,000
Klasse 2GP	63,000
Klasse 3EP	71.251,006
Klasse 3G	76.223,627
Klasse 3GP	680.529,245
Klasse 4GP	5.519.764,743
Klasse 8E	301.271,001
Klasse 8EP	860.721,752
Klasse 8G	47.778,663
Klasse 8GP	458.523,153
Klasse 9EP	71,000
Klasse 9G	57,000
Klasse 9GP	63,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>72.471.914</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	2.705.757
Zinsen auf Bankguthaben	2	209
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>2.705.966</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(659.535)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(5.348)
Betriebskosten	3, 5	(116.617)
Sonstige Gebühren	4	(474)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(781.974)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.923.992</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		4.866.347
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(5.349)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(8.953)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>4.852.045</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.046.085)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(5.046.085)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>1.729.952</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		16.615.466
Anteilrücknahmen		(28.556.605)
Dividenden	7	(1.335.692)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(13.276.831)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>60.925.035</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	60.925.035	72.471.914	40.776.458

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	12,2899	12,2123	8,4207
Klasse AEP	10,7997	11,1512	7,9601
Klasse AUP	10,9127 <sup>1</sup>	11,9099 <sup>1</sup>	7,9466 <sup>1</sup>
Klasse DE	12,1356	12,1020	8,3747
Klasse DEP	10,6571	11,0429	7,9168
Klasse IE	12,6707	12,4632	8,5228
Klasse IEP	11,1344	11,3788	8,0572
Klasse ZE	12,6183	12,4458	8,5167
Klasse ZEP	11,0767	11,3507	8,0497
Klasse 1E	2,0062	1,9917	1,3718
Klasse 1EP	1,0714	1,1057	0,7893
Klasse 1G	1,6952 <sup>2</sup>	1,6964 <sup>2</sup>	1,2138 <sup>2</sup>
Klasse 1GP	0,9066 <sup>2</sup>	0,9428 <sup>2</sup>	0,6989 <sup>2</sup>
Klasse 2E	12,5994	12,4322	8,5107
Klasse 2EP	11,0904	11,3572	8,0536
Klasse 2G	12,1240 <sup>2</sup>	12,0502 <sup>2</sup>	8,5638 <sup>2</sup>
Klasse 2GP	10,6484 <sup>2</sup>	10,9938 <sup>2</sup>	8,0970 <sup>2</sup>
Klasse 3EP	1,7509	1,7928	1,2698
Klasse 3G	1,6454 <sup>2</sup>	1,6343 <sup>2</sup>	1,1606 <sup>2</sup>
Klasse 3GP	1,4708 <sup>2</sup>	1,5182 <sup>2</sup>	1,1214 <sup>2</sup>
Klasse 4GP	1,3081 <sup>2</sup>	1,3394 <sup>2</sup>	0,9796 <sup>2</sup>
Klasse 8E	2,2182	2,1897	1,4996
Klasse 8EP	1,1693	1,1990	0,8512
Klasse 8G	1,8760 <sup>2</sup>	1,8667 <sup>2</sup>	1,3280 <sup>2</sup>
Klasse 8GP	0,9875 <sup>2</sup>	1,0208 <sup>2</sup>	0,7528 <sup>2</sup>
Klasse 9EP	11,1480	11,4256	8,0816
Klasse 9G	12,1739 <sup>2</sup>	12,0857 <sup>2</sup>	8,5782 <sup>2</sup>
Klasse 9GP	10,6983 <sup>2</sup>	11,0352 <sup>2</sup>	8,1121 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.



## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	673.161.083
Bankguthaben	2	2.059.536
Forderungen aus Zeichnungen		366.836
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		457.608
Sonstige Aktiva		541.350
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>676.586.413</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.043.478)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(24.556)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(739.786)
Sonstige Passiva		(180.645)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.988.465)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>673.597.948</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	6.710.995,772
Klasse ASH	489.065,793
Klasse AUH	14.504,457
Klasse DE	1.269.184,850
Klasse DUH	1.177,000
Klasse IE	3.325.935,046
Klasse W	9.912,171
Klasse XE	88,000
Klasse ZE	4.170.201,128
Klasse ZFH	2.681,004

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	50,4135	53,6034	34,7061
Klasse ASH	34,6658 <sup>1</sup>	36,5279 <sup>1</sup>	23,5023 <sup>1</sup>
Klasse AUH	13,4075 <sup>2</sup>	14,0753 <sup>2</sup>	9,0044 <sup>2</sup>
Klasse DE	45,0490	48,3327	31,5752
Klasse DUH	12,9610 <sup>2</sup>	13,7346 <sup>2</sup>	8,8604 <sup>2</sup>
Klasse IE	63,8189	67,3496	43,2819
Klasse W	84,2877	89,6657	58,0840
Klasse XE <sup>4</sup>	10,4050	–	–
Klasse ZE	12,8349	13,5449	8,7046
Klasse ZFH	12,3467 <sup>3</sup>	13,0545 <sup>3</sup>	8,4083 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>4</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>967.772.792</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	10.932.899
Zinsen auf Bankguthaben	2	7.232
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>10.940.131</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(12.007.090)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(26.515)
Betriebskosten	3, 5	(3.128.669)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(15.162.274)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(4.222.143)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		54.814.360
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		1.559.020
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		620.014
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		136
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>56.993.530</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(86.593.775)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(331.978)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(86.925.753)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(34.154.366)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		274.055.250
Anteilrücknahmen		(534.075.728)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(260.020.478)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>673.597.948</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	673.597.948	967.772.792	435.284.977

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.236.815.189
Bankguthaben	2	1.565.833
Forderungen aus Zeichnungen		1.949.816
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		620.755
Sonstige Aktiva		1.450.218
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.242.401.811</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(4.520.681)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(291.620)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.031.470)
Sonstige Passiva		(162.066)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(6.005.837)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.236.395.974</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IE	1.351.581,452
Klasse ZE	1.713.558,640
Klasse 1E	27.660.548,767
Klasse 1EP	919.976,875
Klasse 1FH	287.955,400
Klasse 1G	720.581,820
Klasse 1UH	2.056.222,029
Klasse 2E	17.586.197,336
Klasse 2G	56,000
Klasse 3E	18.839.423,660
Klasse 3EP	1.212.846,309
Klasse 3FH	810.617,242
Klasse 3G	2.201.541,710
Klasse 3GP	219.372,249
Klasse 3UH	1.167.898,932
Klasse 4E	8.426.104,711
Klasse 4G	1.832.020,560
Klasse 8E	6.547.531,023
Klasse 8G	635.357,275
Klasse 9E	9.072.194,700
Klasse 9EP	64,000
Klasse 9FH	20.330,242
Klasse 9G	927.888,277
Klasse 9GP	57,000
Klasse 9UH	263.587,729

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.980.272.935</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	24.874.764
Zinsen auf Bankguthaben	2	10.568
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>24.885.332</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(19.118.026)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(41.158)
Betriebskosten	3, 5	(3.050.423)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(22.209.607)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>2.675.725</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		72.024.793
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		5.343.243
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		433.508
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>77.801.544</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(247.204.353)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(817.779)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(248.022.132)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(167.544.863)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		483.250.537
Anteilrücknahmen		(1.059.165.487)
Dividenden	7	(417.148)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(576.332.098)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.236.395.974</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	1.236.395.974	1.980.272.935	922.670.066

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse IE	12,1084	13,0732	8,6065
Klasse ZE	11,7537	12,7094	8,3794
Klasse 1E	11,4986	12,5109	8,2996
Klasse 1EP	10,9343	12,0777	8,0712
Klasse 1FH	11,3955 <sup>1</sup>	12,4182 <sup>1</sup>	8,2583 <sup>1</sup>
Klasse 1G	10,7968 <sup>2</sup>	11,8416 <sup>2</sup>	8,1606 <sup>2</sup>
Klasse 1UH	12,2785 <sup>3</sup>	13,1915 <sup>3</sup>	8,6456 <sup>3</sup>
Klasse 2E	11,7673	12,7202	8,3840
Klasse 2G	11,0646 <sup>2</sup>	12,0514 <sup>2</sup>	8,2490 <sup>2</sup>
Klasse 3E	11,8366	12,7747	8,4066
Klasse 3EP	11,2596	12,3346	8,1761
Klasse 3FH	11,7317 <sup>1</sup>	12,6823 <sup>1</sup>	8,3663 <sup>1</sup>
Klasse 3G	11,1130 <sup>2</sup>	12,0901 <sup>2</sup>	8,2649 <sup>2</sup>
Klasse 3GP	10,5711 <sup>2</sup>	11,6735 <sup>2</sup>	8,0380 <sup>2</sup>
Klasse 3UH	12,6338 <sup>3</sup>	13,4644 <sup>3</sup>	8,7556 <sup>3</sup>
Klasse 4E	12,1985	13,0550	8,5195
Klasse 4G	12,8182 <sup>2</sup>	13,8285 <sup>2</sup>	9,3745 <sup>2</sup>
Klasse 8E	11,7527	12,7095	8,3804
Klasse 8G	11,0354 <sup>2</sup>	12,0297 <sup>2</sup>	8,2400 <sup>2</sup>
Klasse 9E	11,8550	12,7895	8,4130
Klasse 9EP	11,2856	12,3547	8,1797
Klasse 9FH	11,7487 <sup>1</sup>	12,6978 <sup>1</sup>	8,3720 <sup>1</sup>
Klasse 9G	11,1328 <sup>2</sup>	12,1068 <sup>2</sup>	8,2730 <sup>2</sup>
Klasse 9GP	10,6036 <sup>2</sup>	11,7010 <sup>2</sup>	8,0468 <sup>2</sup>
Klasse 9UH	12,6594 <sup>3</sup>	13,4863 <sup>3</sup>	8,7665 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.619.990.880
Bankguthaben	2	3.076.914
Forderungen aus Zeichnungen		406.008
Sonstige Aktiva		2.912.881
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.626.386.683</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(973.122)
Fällige Bankzinsen		(2.663)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(103.527)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.738.892)
Sonstige Passiva		(181.508)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.999.712)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.623.386.971</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	120.639,994
Klasse AGH	3.784,833
Klasse AUH	12.616,145
Klasse DUH	66,000
Klasse IE	1.117.568,067
Klasse ZE	85,000
Klasse ZG	22.581,768
Klasse ZGH	243.861,343
Klasse 1E	74.418.310,684
Klasse 1EP	875.759,556
Klasse 1SH	2.405.384,391
Klasse 1U	49.354,772
Klasse 1UH	329.971,730
Klasse 2E	11.321.027,255
Klasse 2EP	79.176,000
Klasse 3E	3.831.725,812
Klasse 3U	527.547,916
Klasse 8E	3.044.950,107
Klasse 8EP	33.970,558
Klasse 9E	11.806.406,524
Klasse 9U	63,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.641.460.241</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	20.103.352
Zinsen auf Bankguthaben	2	564
Andere Erträge		16.185
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>20.120.101</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(23.234.982)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(24.467)
Betriebskosten	3, 5	(2.432.115)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(25.691.564)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(5.571.463)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		50.157.180
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		2.915.792
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(63.425)
Realisierter Nettogewinn aus Steuerrückforderung		2
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>53.009.549</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(5.472.348)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(559.525)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(6.031.873)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>41.406.213</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		228.249.523
Anteilrücknahmen		(287.537.364)
Dividenden	7	(191.642)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(59.479.483)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.623.386.971</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

EUR	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
	1.623.386.971	1.641.460.241	1.246.832.227

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	30,1120	29,4285	21,7556
Klasse AGH	32,2683 <sup>1</sup>	31,3771 <sup>1</sup>	23,1092 <sup>1</sup>
Klasse AUH	34,1941 <sup>2</sup>	33,0305 <sup>2</sup>	24,1474 <sup>2</sup>
Klasse DUH	14,2740 <sup>2</sup>	13,8650 <sup>2</sup>	10,1924 <sup>2</sup>
Klasse IE	43,7595	42,4042	31,0840
Klasse ZE <sup>3</sup>	9,1184	–	–
Klasse ZG	14,5919 <sup>1</sup>	14,2678 <sup>1</sup>	10,8756 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	33,3203 <sup>1</sup>	32,1562 <sup>1</sup>	23,5152 <sup>1</sup>
Klasse 1E	14,3703	14,0231	10,3514
Klasse 1EP	13,6418	13,5040	10,0817
Klasse 1SH	14,9506 <sup>3</sup>	14,4595 <sup>3</sup>	10,6075 <sup>3</sup>
Klasse 1U	13,8075 <sup>2</sup>	14,2325 <sup>2</sup>	9,8084 <sup>2</sup>
Klasse 1UH	15,2829 <sup>2</sup>	14,7401 <sup>2</sup>	10,7592 <sup>2</sup>
Klasse 2E	14,6652	14,2266	10,4401
Klasse 2EP	13,9345	13,7092	10,1699
Klasse 3E	14,7570	14,2900	10,4678
Klasse 3U	14,1771 <sup>2</sup>	14,5014 <sup>2</sup>	9,9173 <sup>2</sup>
Klasse 8E	14,6457	14,2134	10,4345
Klasse 8EP	13,9187	13,7016	10,1732
Klasse 9E	14,7765	14,3031	10,4732
Klasse 9U	14,2172 <sup>2</sup>	14,5368 <sup>2</sup>	9,9286 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

\*Siehe Erläuterung 1.

## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	1.769.745.752
Bankguthaben	2	2.771.293
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		88.580
Forderungen aus Zeichnungen		1.926.278
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.048.608
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	88.083
Sonstige Aktiva		2.569.291
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.778.237.885</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(1.339.878)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.051.775)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.922.460)
Sonstige Passiva		(288.572)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(5.602.685)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.772.635.200</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse IE	271.829,655
Klasse ZE	1.117.879,034
Klasse 1E	91.427.361,993
Klasse 1EP	3.287.607,961
Klasse 1FH	61,000
Klasse 2E	5.243.604,633
Klasse 3E	7.313.851,042
Klasse 3EP	772.210,917
Klasse 3FH	774.453,805
Klasse 8E	7.197.758,534
Klasse 9E	10.115.662,517
Klasse 9EP	625.374,000
Klasse 9FH	105,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse IE	12,6494	13,0435	8,4587
Klasse ZE	14,0668	14,5269	9,4347
Klasse 1E	13,7718	14,3106	9,3519
Klasse 1EP	13,1298	13,8388	9,1237
Klasse 1FH	13,6535 <sup>1</sup>	14,2143 <sup>1</sup>	9,3161 <sup>1</sup>
Klasse 2E	14,0850	14,5412	9,4412
Klasse 3E	14,1189	14,5559	9,4377
Klasse 3EP	13,4851	14,0994	9,2225
Klasse 3FH	14,0261 <sup>1</sup>	14,4944 <sup>1</sup>	9,4251 <sup>1</sup>
Klasse 8E	14,0682	14,5297	9,4375
Klasse 9E	14,1693	14,6020	9,4637
Klasse 9EP	13,5144	14,1156	9,2293
Klasse 9FH	14,0265 <sup>1</sup>	14,4918 <sup>1</sup>	9,4226 <sup>1</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.932.987.086</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	21.872.670
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.179
Andere Erträge		9.443
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>21.883.292</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(26.883.130)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(32.877)
Betriebskosten	3, 5	(4.009.298)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(30.925.305)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(9.042.013)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		98.981.901
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		705.537
Realisierter Nettogewinn aus Devisengeschäften		63.542
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>99.750.980</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(152.268.669)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		87.893
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(152.180.776)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(61.471.809)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		290.273.909
Anteilrücknahmen		(388.285.721)
Dividenden	7	(868.265)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(98.880.077)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.772.635.200</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	1.772.635.200	1.932.987.086	1.390.747.109

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	52.513.464
Bankguthaben	2	372.173
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		807.140
Forderungen aus Zeichnungen		30.870
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		224.538
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	43.422
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>53.991.607</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(899.496)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(24.918)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(31.533)
Steuerverbindlichkeit	3	(79.970)
Sonstige Passiva	20	(790.750)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.826.667)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>52.164.940</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	25.073,970
Klasse AU	39.517,654
Klasse AUP	145.908,493
Klasse DEH	74.216,370
Klasse DU	37.279,686
Klasse DUP	41.114,572
Klasse IEP	826.622,287
Klasse IU	70,000
Klasse W	25.604,957
Klasse XU	1.341.544,014
Klasse XUP	282.875,299
Klasse ZG	51,000
Klasse ZGH	6.917,198
Klasse ZGP	56,000
Klasse ZU	100,000
Klasse ZUP	3.674,751

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	45,2875 <sup>1</sup>	49,6140 <sup>1</sup>	28,5781 <sup>1</sup>
Klasse AU	114,4216	123,7850	70,3078
Klasse AUP	13,4844	15,1272	8,9182
Klasse DEH	31,9765 <sup>1</sup>	35,2821 <sup>1</sup>	20,4762 <sup>1</sup>
Klasse DU	55,2874	60,2623	34,4843
Klasse DUP	13,1305	14,8423	8,7791
Klasse IEP	14,0025 <sup>1</sup>	14,7448 <sup>1</sup>	9,1986 <sup>1</sup>
Klasse IU	13,2161	14,1867	7,9943
Klasse W	84,5649	91,6683	52,1698
Klasse XU	14,7814	15,7291	8,7885
Klasse XUP	14,1419	15,6032	8,9896
Klasse ZG	13,8913 <sup>2</sup>	14,2390 <sup>2</sup>	8,9304 <sup>2</sup>
Klasse ZGH	25,8292 <sup>2</sup>	27,9288 <sup>2</sup>	15,9734 <sup>2</sup>
Klasse ZGP	12,2208 <sup>2</sup>	12,9909 <sup>2</sup>	8,4224 <sup>2</sup>
Klasse ZU <sup>†</sup>	9,8775	–	–
Klasse ZUP	15,6966	17,4725	10,1806

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>†</sup>Siehe Erläuterung 1.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>52.863.212</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	1.695.374
Zinsen auf Bankguthaben	2	165
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.695.539</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(312.184)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(15)
Ausländische Steuern	3	(79.788)
Betriebskosten	3, 5	(104.101)
Sonstige Gebühren	4	(9)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(496.097)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>1.199.442</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.698.553
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(348.170)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(64.853)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.285.530</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(6.694.490)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		91.990
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(6.602.500)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(4.117.528)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		17.460.576
Anteilrücknahmen		(13.394.852)
Dividenden	7	(646.468)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>3.419.256</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>52.164.940</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

USD	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
	52.164.940	52.863.212	41.795.505

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	637.799.338
Bankguthaben	2	21.096.330
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.307.766
Forderungen aus Zeichnungen		25.934.870
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		211.639
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	966.982
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>688.316.925</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(35.151.085)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(594.063)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(759.553)
Sonstige Passiva		(148.971)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(36.653.672)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>651.663.253</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	562.926,037
Klasse AS	782.662,846
Klasse AU	3.062.575,834
Klasse AUP	72.808,394
Klasse BU	59.245,502
Klasse DEH	63.331,643
Klasse DU	527.476,907
Klasse IE	342.259,875
Klasse IEH	1.468.977,387
Klasse IG	6.543,913
Klasse IU	6.030.673,242
Klasse ZEH	68.849,133
Klasse ZFH	50.725,815
Klasse ZG	5.854,502
Klasse ZU	1.028.367,784

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	73,7380 <sup>1</sup>	67,4347 <sup>1</sup>	34,4250 <sup>1</sup>
Klasse AS	25,6949 <sup>2</sup>	23,0106 <sup>2</sup>	12,2847 <sup>2</sup>
Klasse AU	98,4809	88,8329	44,7525
Klasse AUP	21,0644	19,1460	9,7092
Klasse BU	124,3152	112,5857	56,9448
Klasse DEH	21,1515 <sup>1</sup>	19,4109 <sup>1</sup>	9,9444 <sup>1</sup>
Klasse DU	144,4193	130,7275	66,0879
Klasse IE	17,4019 <sup>1</sup>	14,7271 <sup>1</sup>	7,8762 <sup>1</sup>
Klasse IEH	25,0771 <sup>1</sup>	22,7318 <sup>1</sup>	11,5005 <sup>1</sup>
Klasse IG	23,2680 <sup>3</sup>	19,8499 <sup>3</sup>	11,0263 <sup>3</sup>
Klasse IU	17,4419	15,5922	7,7851
Klasse ZEH	20,7904 <sup>1</sup>	18,8611 <sup>1</sup>	9,5567 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	24,2713 <sup>4</sup>	22,0485 <sup>4</sup>	11,1832 <sup>4</sup>
Klasse ZG	23,1988 <sup>3</sup>	19,8092 <sup>3</sup>	11,01680 <sup>3</sup>
Klasse ZU	45,0572	40,3192	20,1512

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>537.276.170</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.263.994
Zinsen auf Bankguthaben	2	2.273
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.266.267</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(9.188.529)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(111)
Betriebskosten	3, 5	(1.797.284)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(10.985.924)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(7.719.657)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		88.189.474
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(11.765.137)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(3.133)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>76.421.204</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(23.640.209)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		2.546.988
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(21.093.221)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>47.608.326</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		397.022.400
Anteilrücknahmen		(330.231.852)
Dividenden	7	(11.791)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>66.778.757</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>651.663.253</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	651.663.253	537.276.170	275.490.723

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - UK Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 GBP
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	272.380.604
Bankguthaben	2	877.256
Forderungen aus Zeichnungen		261.324
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		1.774.173
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>275.293.357</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(583.325)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(36.841)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(181.556)
Sonstige Passiva		(38.397)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(840.119)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>274.453.238</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	124.032,982
Klasse AEH	298.704,716
Klasse AFH	9.942,000
Klasse AG	710.331,295
Klasse AGP	72.437,446
Klasse DEH	119.589,129
Klasse DG	3.049,404
Klasse IE	1.240.384,043
Klasse IEH	281.048,167
Klasse IG	1.468.077,107
Klasse IGP	698.619,829
Klasse NEH	66,000
Klasse NFH	73,000
Klasse NG	120.232,000
Klasse NGP	57,000
Klasse NUH	78,000
Klasse TEH	66,000
Klasse TFH	73,000
Klasse TG	57,000
Klasse TGP	57,000
Klasse TUH	78,000
Klasse ZE	17.068,935
Klasse ZEH	400.895,694
Klasse ZFH	3.325,000
Klasse ZG	234.674,829
Klasse ZGP	1.302.016,526
Klasse ZUH	86.959,355
Klasse 3EH	3.289.687,897
Klasse 3FH	42.371,000
Klasse 3UH	2.097.839,912
Klasse 9EH	3.512,000
Klasse 9EP	2.589.832,979
Klasse 9FH	6.085,000
Klasse 9G	8.957.945,165
Klasse 9UH	87,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 GBP
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>296.943.244</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	9.547.579
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.661
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>9.549.240</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(2.610.366)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(156)
Betriebskosten	3, 5	(576.928)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.187.450)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>6.361.790</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		7.338.073
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(315.263)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(10.054)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>7.012.756</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(12.809.567)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		86.280
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(12.723.287)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>651.259</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		181.039.225
Anteilrücknahmen		(201.142.799)
Dividenden	7	(3.037.691)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(23.141.265)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>274.453.238</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
GBP	274.453.238	296.943.244	206.285.143

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - UK Equities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	9,3165 <sup>1</sup>	9,2845 <sup>1</sup>	6,8397 <sup>1</sup>
Klasse AEH	19,9122 <sup>1</sup>	20,1489 <sup>1</sup>	15,5141 <sup>1</sup>
Klasse AFH	9,7085 <sup>2</sup>	9,8231 <sup>2</sup>	7,5610 <sup>2</sup>
Klasse AG	27,8526	27,9800	21,4122
Klasse AGP	20,3018	21,0118	16,5430
Klasse DEH	9,3874 <sup>1</sup>	9,5731 <sup>1</sup>	7,4306 <sup>1</sup>
Klasse DG	9,7276	9,8507	7,5987
Klasse IE	9,9716 <sup>1</sup>	9,8435 <sup>1</sup>	7,1738 <sup>1</sup>
Klasse IEH	30,1611 <sup>1</sup>	30,2322 <sup>1</sup>	23,0551 <sup>1</sup>
Klasse IG	40,7193	40,5187	30,7157
Klasse IGP	29,9926	30,7471	23,9808
Klasse NEH	12,3773 <sup>1</sup>	12,3770 <sup>1</sup>	–
Klasse NFH	12,3772 <sup>2</sup>	12,3746 <sup>2</sup>	–
Klasse NG	12,5034	12,4164	–
Klasse NGP	12,0225	12,2963	–
Klasse NUH	12,6056 <sup>3</sup>	12,4477 <sup>3</sup>	–
Klasse TEH	12,3724 <sup>1</sup>	12,3766 <sup>1</sup>	–
Klasse TFH	12,3703 <sup>2</sup>	12,3738 <sup>2</sup>	–
Klasse TG	12,5042	12,4163	–
Klasse TGP	12,0170	12,2962	–
Klasse TUH	12,6005 <sup>3</sup>	12,4472 <sup>3</sup>	–
Klasse ZE	9,4643 <sup>1</sup>	9,3628 <sup>1</sup>	6,8468 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	12,3480 <sup>1</sup>	12,4008 <sup>1</sup>	9,4773 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	11,9648 <sup>2</sup>	12,0143 <sup>2</sup>	9,1823 <sup>2</sup>
Klasse ZG	26,9947	26,9156	20,4444
Klasse ZGP	10,7776	11,0735	8,6352
Klasse ZUH	10,9752 <sup>3</sup>	10,8824 <sup>3</sup>	10,3032 <sup>3</sup>
Klasse 3EH	1,7608 <sup>1</sup>	1,7651 <sup>1</sup>	1,3466 <sup>1</sup>
Klasse 3FH	1,8918 <sup>2</sup>	1,8962 <sup>2</sup>	–
Klasse 3UH	2,1863 <sup>3</sup>	2,1639 <sup>3</sup>	1,6280 <sup>3</sup>
Klasse 9EH	10,5479 <sup>1</sup>	10,5716 <sup>1</sup>	8,0642 <sup>1</sup>
Klasse 9EP	9,9562 <sup>1</sup>	10,1260 <sup>1</sup>	7,5850 <sup>1</sup>
Klasse 9FH	10,5292 <sup>2</sup>	10,5498 <sup>2</sup>	8,0444 <sup>2</sup>
Klasse 9G	10,1044	10,0527	7,6191
Klasse 9UH	11,2422 <sup>3</sup>	11,1280 <sup>3</sup>	8,3708 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 GBP
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	229.358.950
Bankguthaben	2	2.223.706
Forderungen aus Zeichnungen		990.960
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		753.647
Sonstige Aktiva		835
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>233.328.098</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(423.461)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(91.711)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(141.181)
Sonstige Passiva		(40.445)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(696.798)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>232.631.300</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	2.301.698,636
Klasse AEC	76.812,853
Klasse AEH	161.069,583
Klasse AG	652.629,576
Klasse ASC	133,600
Klasse AUC	596.048,094
Klasse DE	6.446,693
Klasse DEC	12.739,967
Klasse DEH	4.780,573
Klasse DG	65.805,590
Klasse DGP	401,659
Klasse IE	2.475.935,150
Klasse IEH	235.253,572
Klasse IG	252.123,585
Klasse IGP	1.290.206,180
Klasse IU	462.184,559
Klasse IUH	80,000
Klasse LG	324.460,364
Klasse LGP	10.488.137,635
Klasse ZE	23.944,120
Klasse ZEH	25.641,600
Klasse ZFH	10.046,000
Klasse ZG	196.890,795
Klasse ZGP	125.949,927
Klasse ZUH	121.342,889
Klasse 1EH	224.001,179
Klasse 1FH	29.291,102
Klasse 1UH	97.083,387
Klasse 3EH	103.003,293
Klasse 3FH	40.290,742
Klasse 3UH	267.910,899
Klasse 9EH	42.173,000
Klasse 9FH	81,000
Klasse 9G	811.054,244
Klasse 9UH	2.174,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 GBP
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>203.529.182</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	7.512.818
Zinsen auf Bankguthaben	2	751
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>7.513.569</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.705.648)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(44)
Betriebskosten	3, 5	(488.332)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.194.024)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>5.319.545</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		1.659.849
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		203.793
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(33.323)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>1.830.319</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		12.938.288
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		7.525
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>12.945.813</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>20.095.677</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		115.377.001
Anteilrücknahmen		(102.326.922)
Dividenden	7	(4.043.638)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>9.006.441</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>232.631.300</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
GBP	232.631.300	203.529.182	149.344.890

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	12,6812 <sup>1</sup>	11,6608 <sup>1</sup>	8,7982 <sup>1</sup>
Klasse AEC	9,6686 <sup>1</sup>	9,3261 <sup>1</sup>	7,5630 <sup>1</sup>
Klasse AEH	11,5877 <sup>1</sup>	10,8296 <sup>1</sup>	8,5501 <sup>1</sup>
Klasse AG	12,1852	11,2947	8,8527
Klasse ASC	10,1013 <sup>2</sup>	9,6533 <sup>2</sup>	7,8020 <sup>2</sup>
Klasse AUC	10,6068 <sup>3</sup>	10,1151 <sup>3</sup>	8,1166 <sup>3</sup>
Klasse DE	12,1725 <sup>1</sup>	11,2772 <sup>1</sup>	8,5721 <sup>1</sup>
Klasse DEC	9,2267 <sup>1</sup>	8,9790 <sup>1</sup>	7,3487 <sup>1</sup>
Klasse DEH	11,1182 <sup>1</sup>	10,4678 <sup>1</sup>	8,3235 <sup>1</sup>
Klasse DG	11,6992	10,9259	8,6278
Klasse DGP	10,0965	9,7473	7,9234
Klasse IE	13,3535 <sup>1</sup>	12,1630 <sup>1</sup>	9,0906 <sup>1</sup>
Klasse IEH	12,1998 <sup>1</sup>	11,2958 <sup>1</sup>	8,8310 <sup>1</sup>
Klasse IG	12,8573	11,8052	9,1656
Klasse IGP	10,7015	10,1383	8,0999
Klasse IU	13,2640 <sup>3</sup>	12,7617 <sup>3</sup>	8,9046 <sup>3</sup>
Klasse IUH	13,0077 <sup>3</sup>	11,8874 <sup>3</sup>	9,1572 <sup>3</sup>
Klasse LG	12,9575	11,8792	9,2094
Klasse LGP	10,7649	10,1870	8,1168
Klasse ZE	13,2156 <sup>1</sup>	12,0615 <sup>1</sup>	9,0335 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	12,0729 <sup>1</sup>	11,2040 <sup>1</sup>	8,7774 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	11,8925 <sup>4</sup>	11,0386 <sup>4</sup>	8,6609 <sup>4</sup>
Klasse ZG	12,7064	11,6899	9,0942
Klasse ZGP	11,1107	10,5523	8,4466
Klasse ZUH	13,3271 <sup>3</sup>	12,2225 <sup>3</sup>	9,5384 <sup>3</sup>
Klasse 1EH	11,4780 <sup>1</sup>	10,7111 <sup>1</sup>	8,4410 <sup>1</sup>
Klasse 1FH	11,4101 <sup>4</sup>	10,6537 <sup>4</sup>	8,4075 <sup>4</sup>
Klasse 1UH	12,2298 <sup>3</sup>	11,2829 <sup>3</sup>	8,7794 <sup>3</sup>
Klasse 3EH	11,7863 <sup>1</sup>	10,9193 <sup>1</sup>	8,5370 <sup>1</sup>
Klasse 3FH	11,7136 <sup>4</sup>	10,8540 <sup>4</sup>	8,5004 <sup>4</sup>
Klasse 3UH	12,5625 <sup>3</sup>	11,5019 <sup>3</sup>	8,8809 <sup>3</sup>
Klasse 9EH	11,7980 <sup>1</sup>	10,9227 <sup>1</sup>	8,5371 <sup>1</sup>
Klasse 9FH	11,7077 <sup>4</sup>	10,8516 <sup>4</sup>	8,4985 <sup>4</sup>
Klasse 9G	11,4924	10,5508	8,1909
Klasse 9UH	12,5653 <sup>3</sup>	11,4992 <sup>3</sup>	8,8800 <sup>3</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist GBP.

## Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity\*

**AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Bankguthaben	2	1.559.505
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		14
Sonstige Aktiva		21.106
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.580.625</b>
<b>Passiva</b>		
Sonstige Passiva		(470)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(470)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>1.580.155</b>

**ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE**

Klasse IU	398.459,064
Klasse ZU	12.351,905

**AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL**

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse IU	3,8464	3,8047	2,9775
Klasse ZU	3,8469	3,8053	2,9779

**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS**

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>6.857.182</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	96.488
Zinsen auf Bankguthaben	2	113
Andere Erträge		21.106
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>117.707</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(17.778)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(3)
Betriebskosten	3, 5	(10.558)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(28.339)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>89.368</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(610.247)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(2.311)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(42.745)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(655.303)</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		814.708
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>814.708</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>248.773</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		14.466
Anteilrücknahmen		(5.540.266)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(5.525.800)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>1.580.155</b>

**GESAMTNETTOINVENTARWERT**

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	1.580.155	6.857.182	5.920.259

\*Siehe Erläuterung 1.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	23.271.668
Bankguthaben	2	2.304.542
Forderungen aus Zeichnungen		37.929
Zinsforderungen aus Swaps	2	882
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		9.577
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	218.622
Sonstige Aktiva		26
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>25.843.246</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(32.401)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(20.934)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(140.624)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten	2, 11	(894.660)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(9.251)
Sonstige Passiva		(3.891)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.101.761)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>24.741.485</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	48.677,463
Klasse AFH	764,000
Klasse AGH	1.191,640
Klasse AU	104.795,388
Klasse DEH	6.140,089
Klasse DU	74.292,501
Klasse IEH	113.122,400
Klasse IGH	79.194,611
Klasse IU	39.866,488
Klasse XGH	1.013.084,972
Klasse ZE	80,000
Klasse ZEH	83,000
Klasse ZGH	1.832,931
Klasse ZU	100,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	15,5801 <sup>1</sup>	15,3714 <sup>1</sup>	14,9909 <sup>1</sup>
Klasse AFH	14,1612 <sup>2</sup>	13,9949 <sup>2</sup>	13,6841 <sup>2</sup>
Klasse AGH	16,7573 <sup>3</sup>	16,4018 <sup>3</sup>	15,9091 <sup>3</sup>
Klasse AU	17,6966	17,2872	16,6795
Klasse DEH	12,0140 <sup>1</sup>	11,9135 <sup>1</sup>	11,6756 <sup>1</sup>
Klasse DU	13,5433	13,2965	12,8939
Klasse IEH	22,7694 <sup>1</sup>	22,2720 <sup>1</sup>	21,5363 <sup>1</sup>
Klasse IGH	24,2352 <sup>3</sup>	23,5814 <sup>3</sup>	22,6795 <sup>3</sup>
Klasse IU	25,5384	24,8005	23,7275
Klasse XGH	10,8426 <sup>3</sup>	10,4372 <sup>3</sup>	9,9603 <sup>3</sup>
Klasse ZE	11,0174 <sup>1</sup>	10,1161 <sup>1</sup>	10,3731 <sup>1</sup>
Klasse ZEH	9,9289 <sup>1</sup>	9,7263 <sup>1</sup>	9,4119 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	16,6367 <sup>3</sup>	16,1525 <sup>3</sup>	15,5508 <sup>3</sup>
Klasse ZU	10,6198	10,3329	9,8971

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>103.961.830</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	168.950
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.353
Zinsen aus Swaps		11.715
Andere Erträge		461.019
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>643.037</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(101.684)
Performancegebühren	8	(10.424)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(179)
Dividendenaufwand aus Swaps		(167.029)
Zinsaufwand aus Swaps		(40.735)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(13.424)
Betriebskosten	3, 5	(60.007)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(393.482)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>249.555</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		29.489.180
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		391.197
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		927.331
Realisierter Netto(verlust) aus Terminkontrakten		(2.291.352)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(465.699)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>28.050.657</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(25.722.032)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		210.410
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		500.269
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Terminkontrakten		(474.322)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(25.485.675)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>2.814.537</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		4.740.225
Anteilrücknahmen		(86.775.107)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(82.034.882)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>24.741.485</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	24.741.485	103.961.830	180.468.553

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	927.040.046
Bankguthaben	2	24.642.662
Termineinlagen	2, 19	22.045.718
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		4.523.125
Forderungen aus Zeichnungen		343.208
Zinsforderungen aus Swaps	2	503.657
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		10.249.985
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	4.507.807
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	16.594.551
Sonstige Aktiva		4.285
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>1.010.455.044</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(7.313.599)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(790.226)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(1.063.067)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(19.848.526)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(485.942)
Sonstige Passiva		(74.611)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(29.575.971)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>980.879.073</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	85,000
Klasse IE	85,000
Klasse ZE	81.677,475
Klasse 1E	12.550.279,486
Klasse 1EP	59.691,343
Klasse 1GH	172.168,325
Klasse 1UH	196.850,647
Klasse 2E	53.447.204,987
Klasse 2EP	58.548,305
Klasse 2GC	76,000
Klasse 2GH	8.804,776
Klasse 4GH	242.001,138
Klasse 8E	29.498.264,817
Klasse 8EP	121.516,811
Klasse 8GC	37.093,763
Klasse 8GH	906.353,358

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>1.105.181.704</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	5.646
Zinsen aus Anleihen, netto	2	35.780.406
Zinsen auf Bankguthaben	2	1.519
Zinsen aus Swaps		1.825.906
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>37.613.477</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(6.394.014)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(645.048)
Zinsaufwand aus Swaps		(22.073.515)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(606.452)
Betriebskosten	3, 5	(968.217)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(30.687.246)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>6.926.231</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(1.581.060)
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(2.715.833)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(19.481.745)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		7.967.788
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(2.337.453)
<b>Realisierter Netto(verlust)</b>		<b>(18.148.303)</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(50.711.806)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		18.829.453
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		7.681.966
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		12.813.307
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(11.387.080)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(22.609.152)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		266.552.665
Anteilrücknahmen		(368.158.596)
Dividenden	7	(87.548)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(101.693.479)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>980.879.073</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	980.879.073	1.105.181.704	1.551.456.289

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE <sup>‡</sup>	9,7720	–	–
Klasse IE <sup>‡</sup>	9,8024	–	–
Klasse ZE	9,9967	10,2122	9,3241
Klasse 1E	9,8622	10,1181	9,2723
Klasse 1EP	8,7147	9,2533	8,7619
Klasse 1GH	10,1307 <sup>‡</sup>	10,3276 <sup>‡</sup>	9,4190 <sup>‡</sup>
Klasse 1UH	10,4460 <sup>‡</sup>	10,6393 <sup>‡</sup>	9,6685 <sup>‡</sup>
Klasse 2E	10,0810	10,2797	9,3632
Klasse 2EP	8,8919	9,3705	8,8321
Klasse 2GC	9,1211 <sup>‡</sup>	9,5453 <sup>‡</sup>	8,9432 <sup>‡</sup>
Klasse 2GH	10,3563 <sup>‡</sup>	10,4925 <sup>‡</sup>	9,5119 <sup>‡</sup>
Klasse 4GH	10,5443 <sup>‡</sup>	10,6305 <sup>‡</sup>	9,5888 <sup>‡</sup>
Klasse 8E	10,0626	10,2650	9,3536
Klasse 8EP	8,8993	9,3952	8,8706
Klasse 8GC	9,1415 <sup>‡</sup>	9,5801 <sup>‡</sup>	8,9861 <sup>‡</sup>
Klasse 8GH	10,3438 <sup>‡</sup>	10,4843 <sup>‡</sup>	9,5069 <sup>‡</sup>

<sup>‡</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>‡</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>‡</sup>Siehe Erläuterung 1.



## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	41.612.044
Bankguthaben	2	1.994.512
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		695.676
Zinsforderungen aus Swaps	2	17.452
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		392.264
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	2, 11	1.031.021
Sonstige Aktiva		11.153
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>45.754.122</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(669.403)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(32.914)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten	2, 9	(22.268)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(394.002)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.081)
Sonstige Passiva		(6.050)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.125.718)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>44.628.404</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	374,659
Klasse AFH	92,200
Klasse AKH	84,000
Klasse ANH	830,000
Klasse AUH	92,000
Klasse DE	17.592,059
Klasse IE	283.028,942
Klasse IEP	89,999
Klasse IGH	67,800
Klasse INH	826,000
Klasse IU	92,000
Klasse IUH	90,000
Klasse JE	80,997
Klasse JGH	67,800
Klasse JUH	91,000
Klasse LE	9.581,001
Klasse LEP	89,320
Klasse LGH	67,800
Klasse XE	305.450,604
Klasse XGH	3.137.880,322
Klasse XUH	92,000
Klasse YE	82,001
Klasse YGH	68,800
Klasse YUH	91,000
Klasse ZE	81,997
Klasse ZFH	90,200
Klasse ZGH	67,800
Klasse ZUH	91,000

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>53.361.804</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	1.311.801
Zinsen auf Bankguthaben	2	337
Zinsen aus Swaps		101.624
Andere Erträge		16
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>1.413.778</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(13.357)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(27.828)
Zinsaufwand aus Swaps		(795.220)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(9.993)
Betriebskosten	3, 5	(83.684)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(930.082)</b>
<b>Nettoertrag aus Anlagen</b>		<b>483.696</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		122.149
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(420.291)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		316.072
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		608.022
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(15.182)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>610.770</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(2.765.999)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.048.387
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(371.290)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Terminkontrakten		740.167
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(1.348.735)</b>
<b>Netto(rückgang) des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>(254.269)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		3.362.176
Anteilrücknahmen		(11.841.263)
Dividenden	7	(44)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(8.479.131)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>44.628.404</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	44.628.404	53.361.804	65.678.771

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	9,9429	10,2349	9,4969
Klasse AFH	9,8101 <sup>1</sup>	10,1268 <sup>1</sup>	9,4156 <sup>1</sup>
Klasse AKH	99,6323 <sup>2</sup>	102,3358 <sup>2</sup>	94,6358 <sup>2</sup>
Klasse ANH	10,1446 <sup>3</sup>	10,3661 <sup>3</sup>	9,5560 <sup>3</sup>
Klasse AUH	10,6635 <sup>4</sup>	10,8977 <sup>4</sup>	10,0302 <sup>4</sup>
Klasse DE	9,7208	10,0608	9,3822
Klasse IE	10,2044	10,4353	9,6157
Klasse IEP	9,0524	9,4983	9,0726
Klasse IGH	10,5320 <sup>5</sup>	10,6920 <sup>5</sup>	9,8133 <sup>5</sup>
Klasse INH	10,2572 <sup>3</sup>	10,4013 <sup>3</sup>	9,5374 <sup>3</sup>
Klasse IU	10,0660 <sup>4</sup>	10,8726 <sup>4</sup>	9,3587 <sup>4</sup>
Klasse IUH	10,9297 <sup>4</sup>	11,0910 <sup>4</sup>	10,1441 <sup>4</sup>
Klasse JE	10,1884	10,4159	9,6164
Klasse JGH	10,5456 <sup>5</sup>	10,6939 <sup>5</sup>	9,8127 <sup>5</sup>
Klasse JUH	10,8783 <sup>4</sup>	11,0321 <sup>4</sup>	10,1046 <sup>4</sup>
Klasse LE	10,2635	10,4800	9,6450
Klasse LEP	9,1580	9,5877	9,1359
Klasse LGH	10,6048 <sup>5</sup>	10,7382 <sup>5</sup>	9,8349 <sup>5</sup>
Klasse XE	10,5895	10,7859	–
Klasse XGH	10,2913 <sup>5</sup>	10,4148 <sup>5</sup>	9,5116 <sup>5</sup>
Klasse XUH	10,7628 <sup>4</sup>	10,8737 <sup>4</sup>	–
Klasse YE	10,1443	10,3910	9,5989
Klasse YGH	10,4650 <sup>5</sup>	10,6432 <sup>5</sup>	9,7812 <sup>5</sup>
Klasse YUH	10,8066 <sup>4</sup>	10,9872 <sup>4</sup>	10,0801 <sup>4</sup>
Klasse ZE	10,1272	10,3835	9,5865
Klasse ZFH	9,9880 <sup>1</sup>	10,2620 <sup>1</sup>	9,4998 <sup>1</sup>
Klasse ZGH	10,4758 <sup>5</sup>	10,6642 <sup>5</sup>	9,7911 <sup>5</sup>
Klasse ZUH	10,8614 <sup>4</sup>	11,0490 <sup>4</sup>	10,1215 <sup>4</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf SEK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf NOK. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

<sup>5</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	120.954.454
Bankguthaben	2	2.724.513
Forderungen aus Zeichnungen		29.207
Zinsforderungen aus Swaps	2	2.769.351
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	947
Sonstige Aktiva		124.813
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>126.603.285</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(94.734)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(1.684.080)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(798.926)
Fällige Bankzinsen		(3.931)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(47.003)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(107.778)
Sonstige Passiva		(27.757)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(2.764.209)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>123.839.076</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AE	2.285.948,793
Klasse AEP	28.384,783
Klasse AUH	2.007,000
Klasse DE	2.318.243,552
Klasse IE	2.599.445,200
Klasse IGH	17.209,797
Klasse LE	1.493.004,591
Klasse XGH	783.616,969
Klasse ZE	226.874,173
Klasse ZF	76,000
Klasse ZFH	6.377,000
Klasse ZGH	57,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AE	12,1389	11,9823	11,8815
Klasse AEP	12,3867	12,3580	12,2004
Klasse AUH	13,1642 <sup>1</sup>	12,8933 <sup>1</sup>	12,6049 <sup>1</sup>
Klasse DE	11,7798	11,7839	11,6749
Klasse IE	12,6164	12,5007	12,2490
Klasse IGH	12,9699 <sup>2</sup>	12,7513 <sup>2</sup>	12,4217 <sup>2</sup>
Klasse LE	12,8174	12,6752	12,3472
Klasse XGH	14,3002 <sup>2</sup>	13,8662 <sup>2</sup>	13,3602 <sup>2</sup>
Klasse ZE	12,6671	12,5092	12,2555
Klasse ZF	11,5379 <sup>3</sup>	12,2367 <sup>3</sup>	11,4828 <sup>3</sup>
Klasse ZFH	11,9019 <sup>3</sup>	11,8267 <sup>3</sup>	11,6341 <sup>3</sup>
Klasse ZGH	13,1142 <sup>2</sup>	12,7204 <sup>2</sup>	12,3878 <sup>2</sup>

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf USD. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist EUR.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>235.387.755</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	3.002.152
Zinsen auf Bankguthaben	2	2.503
Zinsen aus Swaps		69.426
Andere Erträge		236.518
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>3.310.599</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.664.853)
Performancegebühren	8	(650.870)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(40.013)
Dividendenaufwand aus Swaps		(2.785.573)
Zinsaufwand aus Swaps		(882.355)
Betriebskosten	3, 5	(430.584)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(6.454.248)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(3.143.649)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		34.866.611
Realisierter Netto(verlust) aus Swaps		(8.777.916)
Realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten		562.354
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(196.715)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>26.454.334</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(19.964.207)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		2.175.281
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Devisenterminkontrakten		(888.134)
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(18.677.060)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>4.633.625</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		63.347.675
Anteilrücknahmen		(179.528.760)
Dividenden	7	(1.219)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(116.182.304)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>123.839.076</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
EUR	123.839.076	235.387.755	145.122.405

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	123.021.949
Bankguthaben	2	3.106.415
Forderungen aus Zeichnungen		47.606
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		40.870
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	25.457
Sonstige Aktiva		5
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>126.242.302</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(240.126)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(96.019)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(2.933)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(16.672)
Nicht realisierter Netto(verlust) aus Swaps	2, 10	(530.036)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(139.685)
Sonstige Passiva		(18.386)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(1.043.857)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>125.198.445</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	573,326
Klasse AU	1.878,961
Klasse DEH	219,748
Klasse DU	30.219,037
Klasse IU	202.738,502
Klasse ZU	57,000
Klasse 1E	3.457.515,996
Klasse 1EH	365.391,742
Klasse 1U	7.051.234,817
Klasse 2E	49,000
Klasse 2U	186,000
Klasse 3U	45.196,000
Klasse 8E	304.516,502
Klasse 8U	2.052.290,097
Klasse 9U	56,000

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	16,4272 <sup>1</sup>	14,7944 <sup>1</sup>	9,6105 <sup>1</sup>
Klasse AU	17,4066	15,4832	9,9317
Klasse DEH	16,1610 <sup>1</sup>	14,6365 <sup>1</sup>	9,5551 <sup>1</sup>
Klasse DU	17,1211	15,3058	9,8657
Klasse IU	17,9132	15,7911	10,0392
Klasse ZU	17,8411	15,7432	10,0184
Klasse 1E	8,1204 <sup>1</sup>	6,8306 <sup>1</sup>	4,6882 <sup>1</sup>
Klasse 1EH	5,9805 <sup>1</sup>	5,3803 <sup>1</sup>	3,4943 <sup>1</sup>
Klasse 1U	9,0336	8,0266	5,1432
Klasse 2E	18,3931 <sup>1</sup>	15,3339 <sup>1</sup>	10,4354 <sup>1</sup>
Klasse 2U	17,9863	15,8326	10,0509
Klasse 3U	5,1096	4,5061	2,8659
Klasse 8E	8,9701 <sup>1</sup>	7,4837 <sup>1</sup>	5,0947 <sup>1</sup>
Klasse 8U	9,9191	8,7414	5,5557
Klasse 9U	17,9452	15,8025	10,0466

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>112.622.890</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	727.808
Zinsen auf Bankguthaben	2	513
Zinsen aus Swaps		24.066
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>752.387</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.603.305)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(121)
Dividendenaufwand aus Swaps		(127.712)
Zinsaufwand aus Swaps		(241.566)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(1.474)
Betriebskosten	3, 5	(211.328)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.185.506)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.433.119)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		36.575.786
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		2.343.050
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(254.883)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(14.619)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>38.649.334</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(22.959.388)
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Swaps		(431.043)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		83.848
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(23.306.583)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>13.909.632</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		31.151.939
Anteilrücknahmen		(32.486.016)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(1.334.077)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>125.198.445</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	125.198.445	112.622.890	107.950.260

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	85.756.625
Bankguthaben	2	3.966.191
Termineinlagen	2, 19	6.001.631
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		2.154.642
Forderungen aus Zeichnungen		41.733
Zinsforderungen aus Swaps	2	4.839
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		174.699
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	14.339
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	1.865.712
Sonstige Aktiva		45.733
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>100.026.144</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(600.459)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(48.238)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(75.760)
Dividendenverbindlichkeiten aus Swaps	2	(40.810)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(118.226)
Sonstige Passiva		(15.347)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(898.840)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>99.127.304</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	69.693,942
Klasse AU	17.894,673
Klasse DEH	15.040,656
Klasse DU	618,597
Klasse IU	208.389,000
Klasse ZU	58,000
Klasse 1E	14.787.097,762
Klasse 1U	924.780,204
Klasse 2E	52,000
Klasse 2U	1.214,250
Klasse 8E	208.344,215
Klasse 8U	202.845,119

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	14,5886 <sup>1</sup>	15,0223 <sup>1</sup>	10,3913 <sup>1</sup>
Klasse AU	15,4367	15,6740	10,7050
Klasse DEH	14,4782 <sup>1</sup>	14,9762 <sup>1</sup>	10,4242 <sup>1</sup>
Klasse DU	15,2753	15,5884	10,6942
Klasse IU	16,0451	16,1456	10,9288
Klasse ZU	15,8776	15,9900	10,8327
Klasse 1E	5,2295 <sup>1</sup>	5,0213 <sup>1</sup>	3,6694 <sup>1</sup>
Klasse 1U	5,8275	5,9106	4,0324
Klasse 2E	16,3297 <sup>1</sup>	15,5305 <sup>1</sup>	11,2523 <sup>1</sup>
Klasse 2U	15,9419	16,0307	10,8434
Klasse 8E	5,8070 <sup>1</sup>	5,5302 <sup>1</sup>	4,0084 <sup>1</sup>
Klasse 8U	6,5431	6,5821	4,4540

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>209.555.266</b>
<b>Ertrag</b>		
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	2	868.157
Zinsen auf Bankguthaben	2	2.973
Zinsen aus Swaps		64.043
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>935.173</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.793.772)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(920)
Dividendenaufwand aus Swaps		(282.048)
Zinsaufwand aus Swaps		(418.876)
Betriebskosten	3, 5	(232.688)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(2.728.304)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(1.793.131)</b>
Realisierter Nettogewinn aus dem Verkauf von Anlagen		38.877.425
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		2.548.639
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(274.739)
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(24.307)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>41.127.018</b>
Änderung des nicht realisierten Netto(verlusts) aus Anlagen		(36.814.864)
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		1.378.985
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		56.037
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Netto(verlust)</b>		<b>(35.379.842)</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>3.954.045</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		10.897.165
Anteilrücknahmen		(125.279.172)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(114.382.007)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>99.127.304</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	99.127.304	209.555.266	163.281.752

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### AUFSTELLUNG DES NETTOVERMÖGENS

zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Aktiva</b>		
Wertpapierbestand zum Marktwert	2	509.285.871
Bankguthaben	2	18.384.421
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		106.992.835
Forderungen aus Zeichnungen		3.832.326
Forderungen aus Zinsen und Dividenden, netto		2.927
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisenterminkontrakten	2, 9	1.206.919
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swaps	2, 10	17.857.131
Sonstige Aktiva		6.549
<b>Aktiva, insgesamt</b>		<b>657.568.979</b>
<b>Passiva</b>		
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		(107.327.904)
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		(2.919.498)
Zinsverbindlichkeiten aus Swaps	2	(38.637)
Verbindlichkeiten aus Anlageverwaltungsgebühren	5	(122.260)
Sonstige Passiva		(75.947)
<b>Passiva, insgesamt</b>		<b>(110.484.246)</b>
<b>Nettovermögen, insgesamt</b>		<b>547.084.733</b>

### ANZAHL DER AUSSTEHENDEN ANTEILE

Klasse AEH	309.845,928
Klasse AFH	230.991,729
Klasse AGH	77.463,636
Klasse ASH	2.408.777,989
Klasse AU	1.972.778,299
Klasse DEH	198.616,812
Klasse DU	631.463,177
Klasse IEH	411.970,554
Klasse IG	64,000
Klasse IGH	3.037.876,866
Klasse IU	628.133,021
Klasse NG	87.673,069
Klasse XU	16.497.669,269
Klasse ZEH	26.682,627
Klasse ZFH	160,000
Klasse ZGH	475.194,725
Klasse ZU	156.990,605

### ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND ENTWICKLUNG DES NETTOVERMÖGENS

für das Berichtsjahr zum 31. März 2022

	Erläuterungen	2022 USD
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>528.893.598</b>
<b>Ertrag</b>		
Zinsen aus Anleihen, netto	2	206.387
Zinsen auf Bankguthaben	2	7.235
Zinsen aus Swaps		11.022
<b>Erträge, insgesamt</b>		<b>224.644</b>
<b>Aufwand</b>		
Anlageverwaltungsgebühren	5	(1.585.265)
Zinsen auf Bankguthaben	2	(3.612)
Zinsaufwand aus Swaps		(844.106)
Zinsaufwand aus Terminkontrakten		(130)
Betriebskosten	3, 5	(810.073)
<b>Aufwand, insgesamt</b>		<b>(3.243.186)</b>
<b>Netto(verlust) aus Anlagen</b>		<b>(3.018.542)</b>
Realisierter Netto(verlust) aus dem Verkauf von Anlagen		(2.916)
Realisierter Nettogewinn aus Swaps		165.226.083
Realisierter Netto(verlust) aus Devisenterminkontrakten		(6.954.576)
Realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten		315.210
Realisierter Netto(verlust) aus Devisengeschäften		(109.769)
<b>Realisierter Nettogewinn</b>		<b>158.474.032</b>
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Anlagen		305.638
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Swaps		31.742.204
Änderung des nicht realisierten Nettogewinns aus Devisenterminkontrakten		1.598.080
<b>Nettoänderung bei nicht realisiertem Nettogewinn</b>		<b>33.645.922</b>
<b>Nettoerhöhung des Nettovermögens aus Geschäftstätigkeit</b>		<b>189.101.412</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen von Anteilen		243.291.141
Anteilrücknahmen		(414.201.418)
<b>Kapitalbewegungen, insgesamt</b>		<b>(170.910.277)</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>547.084.733</b>

### GESAMTNETTOINVENTARWERT

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
USD	547.084.733	528.893.598	292.751.295

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### AUFSTELLUNG DES NETTOINVENTARWERTS JE ANTEIL

	31. März 2022	31. März 2021	31. März 2020
Klasse AEH	12,2529 <sup>1</sup>	8,4906 <sup>1</sup>	6,3865 <sup>1</sup>
Klasse AFH	9,0157 <sup>2</sup>	6,2739 <sup>2</sup>	4,7274 <sup>2</sup>
Klasse AGH	13,1736 <sup>3</sup>	9,0951 <sup>3</sup>	6,8077 <sup>3</sup>
Klasse ASH	6,9266 <sup>4</sup>	4,7702 <sup>4</sup>	3,5575 <sup>4</sup>
Klasse AU	14,5604	10,0129	7,4279
Klasse DEH	9,2625 <sup>1</sup>	6,4457 <sup>1</sup>	4,8729 <sup>1</sup>
Klasse DU	11,0114	7,6039	5,6690
Klasse IEH	18,1687 <sup>1</sup>	12,4903 <sup>1</sup>	9,2968 <sup>1</sup>
Klasse IG	15,4257 <sup>3</sup>	10,0476 <sup>3</sup>	8,2193 <sup>3</sup>
Klasse IGH	19,4921 <sup>3</sup>	13,3493 <sup>3</sup>	9,8874 <sup>3</sup>
Klasse IU	21,5661	14,7124	10,8005
Klasse NG	14,9110 <sup>3</sup>	9,6735 <sup>3</sup>	7,8743 <sup>3</sup>
Klasse XU	22,9751	15,5436	11,3145
Klasse ZEH	7,6710 <sup>1</sup>	5,2751 <sup>1</sup>	3,9285 <sup>1</sup>
Klasse ZFH	7,3902 <sup>2</sup>	5,1075 <sup>2</sup>	3,8109 <sup>2</sup>
Klasse ZGH	11,1531 <sup>3</sup>	7,6437 <sup>3</sup>	5,6644 <sup>3</sup>
Klasse ZU	8,8906	6,0682	4,4569

<sup>1</sup>Die Klasse lautet auf EUR. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>2</sup>Die Klasse lautet auf CHF. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>3</sup>Die Klasse lautet auf GBP. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

<sup>4</sup>Die Klasse lautet auf SGD. Die Basiswährung des Portfolios ist USD.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>DÄNEMARK</b>					
EUR	2.106.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	2.060.376	0,40	EUR	476.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	499.710	0,10
USD	1.508.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	1.540.915	0,30	<b>Dänemark, insgesamt</b>				
EUR	1.072.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.192.266	0,23	<b>FINNLAND</b>				
USD	2.215.000	SGSP Australia Assets Pty 3.50% 07/07/2027	2.213.536	0,43	EUR	946.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	1.014.027	0,20
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>7.007.093</b>	<b>1,36</b>	EUR	3.895.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	4.019.674	0,78
				<b>Finnland, insgesamt</b>					
				<b>5.033.701</b>					
				<b>0,98</b>					
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH</b>					
EUR	835.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	1.120.120	0,22	EUR	2.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	2.980.919	0,58
EUR	250.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	335.365	0,07	EUR	600.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	589.933	0,12
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>1.455.485</b>	<b>0,29</b>	EUR	2.200.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	2.122.038	0,41
				<b>BERMUDAS</b>					
USD	1.922.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	2.154.889	0,42	EUR	1.700.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.738.180	0,34
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>2.154.889</b>	<b>0,42</b>	EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	2.198.905	0,43
				<b>KANADA</b>					
USD	1.102.000	Canadian Pacific Railway Company 3.10% 02/12/2051	980.000	0,20	EUR	2.035.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	1.960.523	0,38
USD	450.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	406.249	0,08	EUR	1.200.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	1.263.446	0,25
<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>1.386.249</b>	<b>0,28</b>	EUR	900.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	905.854	0,18
				<b>DEUTSCHLAND</b>					
				<b>KAIMANINSELN</b>					
USD	732.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037	684.091	0,13	EUR	800.000	Adler Real Estate AG 3.00% 27/04/2026	813.851	0,16
GBP	3.580.000	Southern Water Services Limited 1.63% 30/03/2027	4.483.485	0,87	EUR	1.000.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	1.045.444	0,20
GBP	2.804.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	3.608.946	0,70	EUR	3.200.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	2.995.555	0,58
GBP	560.000	Southern Water Services Limited 3.00% 28/05/2037	712.060	0,14	EUR	1.000.000	Commerzbank AG FRN 29/12/2031	1.004.795	0,20
USD	566.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050	443.045	0,09	EUR	3.200.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	3.648.897	0,71
USD	1.008.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	986.933	0,19	EUR	1.298.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	1.454.471	0,28
USD	1.000.000	Tencent Holdings Limited 3.93% 19/01/2038	927.472	0,18	EUR	900.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	937.336	0,18
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>11.846.032</b>	<b>2,30</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
USD	1.610.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	1.447.606	0,28	USD	1.447.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	1.303.078	0,25
EUR	349.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	385.859	0,08	USD	2.364.160	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	2.147.200	0,42
EUR	1.400.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.329.929	0,26	EUR	1.176.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.189.217	0,23
EUR	491.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	584.543	0,11	EUR	300.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	307.936	0,06
EUR	1.100.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	1.005.875	0,20					
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>16.654.161</b>	<b>3,24</b>			<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>4.947.431</b>	<b>0,96</b>
<b>INDIEN</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
USD	1.830.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.764.842	0,33	EUR	1.600.000	Aroundtown SA 0.00% 16/07/2026	1.628.199	0,32
USD	1.380.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	1.265.561	0,25	EUR	2.900.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.947.127	0,57
		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>3.030.403</b>	<b>0,58</b>	EUR	1.000.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	1.039.031	0,20
<b>IRLAND</b>				<b>MEXIKO</b>					
EUR	2.330.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	2.535.515	0,49	EUR	700.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	723.475	0,14
EUR	900.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	989.542	0,19			<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>723.475</b>	<b>0,14</b>
EUR	1.482.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	1.531.356	0,30					
EUR	1.350.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	1.379.481	0,27					
EUR	2.057.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	2.249.896	0,44					
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>8.685.790</b>	<b>1,69</b>			<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>17.554.154</b>	<b>3,42</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
EUR	427.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 02/02/2029	451.242	0,09	EUR	302.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	343.491	0,07
EUR	598.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	610.142	0,12	EUR	746.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	712.661	0,14
EUR	950.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	999.439	0,19	EUR	1.036.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	1.042.836	0,20
EUR	801.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	867.662	0,17	EUR	1.020.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.046.543	0,20
EUR	1.284.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	1.343.218	0,26					
EUR	749.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	758.732	0,15					
EUR	673.000	Eni SpA Perp FRN	717.074	0,14					
EUR	663.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	704.225	0,14					
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>6.451.734</b>	<b>1,26</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>SCHWEIZ (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.193.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	1.167.706	0,23	USD	330.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	342.427	0,07
GBP	2.114.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	3.467.624	0,68	EUR	2.497.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.531.367	0,49
EUR	1.127.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	1.168.644	0,23	USD	623.000	UBS AG 5.13% 15/05/2024	638.158	0,12
EUR	1.300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.317.350	0,26	USD	530.000	UBS Group AG Perp FRN	533.986	0,10
EUR	2.000.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	2.188.349	0,43	USD	900.000	UBS Group AG Perp FRN	956.942	0,20
USD	1.025.000	ING Groep NV FRN 28/03/2033	1.054.838	0,21	USD	768.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	803.426	0,16
EUR	850.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	831.103	0,16	<b>Schweiz, insgesamt</b>			<b>12.207.628</b>	<b>2,38</b>
GBP	820.000	Shell International Finance BV 1.75% 10/09/2052	785.385	0,15	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	3.300.000	Stedin Holding NV Perp FRN	3.540.783	0,69	USD	491.000	Anglo American Capital plc 4.75% 16/03/2052	513.809	0,10
EUR	1.000.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	965.052	0,19	USD	3.779.000	BAE Systems plc 3.40% 15/04/2030	3.732.219	0,73
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	577.211	0,11	USD	2.257.000	Barclays plc FRN 24/11/2032	2.047.879	0,40
EUR	3.883.000	Tennet Holding BV Perp FRN	4.337.819	0,84	GBP	1.680.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	1.998.343	0,39
EUR	2.297.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	2.303.025	0,45	USD	2.001.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	2.017.224	0,39
EUR	2.100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	2.207.340	0,43	EUR	1.443.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.612.722	0,31
EUR	1.600.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	2.134.595	0,42	EUR	2.459.000	British American Tobacco plc Perp FRN	2.497.289	0,48
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>31.192.355</b>	<b>6,09</b>	GBP	750.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	1.084.564	0,21
<b>SPANIEN</b>					GBP	479.716	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	702.307	0,14
EUR	1.300.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	1.275.381	0,25	EUR	2.591.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	2.611.364	0,51
EUR	309.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	342.807	0,07	EUR	507.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	501.028	0,10
<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>1.618.188</b>	<b>0,32</b>	GBP	1.626.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	2.097.626	0,41
<b>SCHWEDEN</b>					GBP	425.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	566.719	0,11
EUR	2.254.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	2.353.992	0,46	EUR	424.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	500.297	0,10
EUR	573.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	644.595	0,13	EUR	28.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	33.039	0,01
<b>Schweden, insgesamt</b>			<b>2.998.587</b>	<b>0,59</b>	GBP	1.398.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	2.171.663	0,42
<b>SCHWEIZ</b>					GBP	950.000	HSBC Holdings plc FRN 24/07/2027	1.178.857	0,23
EUR	1.714.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	1.716.567	0,33	USD	931.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2032	848.051	0,17
USD	4.104.000	Credit Suisse Group AG FRN 14/05/2032	3.696.345	0,72	USD	850.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	831.894	0,16
USD	1.000.000	Credit Suisse Group AG FRN 01/04/2031	988.410	0,19	GBP	453.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	646.558	0,13

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
EUR	773.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	868.161	0,17	USD	2.982.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	3.131.031	0,60
GBP	278.000 Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	376.198	0,07	USD	1.217.000 AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	1.388.042	0,27
GBP	520.000 Legal & General Group plc FRN 27/06/2064	754.679	0,15	USD	875.000 AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	781.144	0,15
GBP	2.070.000 Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	3.075.711	0,60	USD	2.720.000 Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	2.566.773	0,50
EUR	867.000 Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	889.685	0,17	USD	1.265.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	1.242.487	0,24
EUR	1.626.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	1.612.502	0,31	USD	1.805.000 Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	1.654.460	0,32
EUR	780.000 National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	773.525	0,15	USD	481.000 Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	499.351	0,10
GBP	720.000 National Grid plc 3.50% 16/10/2026	982.249	0,19	USD	2.012.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	2.191.665	0,43
EUR	2.685.000 Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	2.714.474	0,52	USD	540.000 Anheuser-Busch Companies LLC 4.90% 01/02/2046	602.301	0,12
USD	2.864.000 Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	2.642.355	0,52	USD	2.274.000 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.659.093	0,51
EUR	1.758.000 Natwest Group plc FRN 26/02/2030	1.804.623	0,35	USD	1.306.000 Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	1.140.304	0,22
USD	1.255.000 NatWest Group plc FRN 08/05/2030	1.289.318	0,25	EUR	854.000 Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	878.112	0,17
GBP	458.000 Natwest Group plc Perp FRN	597.025	0,12	USD	533.000 AT&T Inc. 3.10% 01/02/2043	462.491	0,09
EUR	2.505.000 NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.608.235	0,51	USD	535.000 AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	493.690	0,10
GBP	683.000 Phoenix Group Holdings plc 5.63% 28/04/2031	984.864	0,19	USD	4.127.000 AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	3.660.307	0,70
GBP	270.000 Santander UK plc Perp 10.06%	625.206	0,12	CAD	1.500.000 AT&T Inc. 4.00% 25/11/2025	1.218.881	0,24
GBP	1.121.000 Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	1.404.863	0,27	USD	1.997.000 AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	2.175.493	0,41
GBP	419.829 Tesco Property Finance plc 7.62% 13/07/2039	738.200	0,14	USD	1.350.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	1.199.748	0,23
GBP	1.208.680 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	1.877.617	0,37	USD	1.617.000 Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	1.488.215	0,29
GBP	489.325 Tesco Property Finance 6 plc 5.41% 13/07/2044	745.227	0,15	USD	1.933.000 Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	1.787.415	0,35
GBP	1.120.000 Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	1.424.576	0,28	USD	6.226.000 Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	5.720.679	1,13
EUR	2.798.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	2.959.136	0,58	USD	3.000.000 Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	2.816.612	0,55
GBP	1.010.000 Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	1.254.529	0,24	USD	1.238.000 Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	1.198.913	0,23
EUR	1.463.000 Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	1.584.254	0,31	USD	1.500.000 Bayer US Finance II LLC 4.63% 25/06/2038	1.577.186	0,31
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>62.780.664</b>	<b>12,23</b>	USD	1.349.000 Becton Dickinson 4.69% 15/12/2044	1.458.165	0,28
				USD	844.000 Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	921.433	0,18
				USD	2.011.000 Boeing Company 3.95% 01/08/2059	1.750.362	0,34
				USD	750.000 Boeing Company 5.93% 01/05/2060	872.380	0,17
				USD	693.000 Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	699.240	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	1.002.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	1.014.942	0,20	USD	1.750.000	General Motors Financial Company Inc. 2.40% 15/10/2028	1.573.264	0,31
USD	630.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	671.234	0,13	USD	491.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	460.945	0,09
USD	2.376.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	1.928.082	0,38	USD	489.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	489.431	0,10
USD	1.548.000	Chubb Ina Holdings Inc. 3.05% 15/12/2061	1.341.924	0,26	USD	1.000.000	Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	901.468	0,18
USD	757.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	854.603	0,17	USD	849.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	993.971	0,19
EUR	1.012.000	Citigroup Inc. FRN 06/07/2026	1.122.191	0,22	EUR	1.119.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	1.216.885	0,24
USD	3.020.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	3.143.039	0,61	EUR	400.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	423.675	0,08
USD	343.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	358.752	0,07	EUR	330.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/09/2025	369.548	0,07
USD	250.000	Conagra Brands Inc. 5.40% 01/11/2048	287.157	0,06	USD	1.710.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	1.499.614	0,29
USD	303.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	313.818	0,06	USD	2.673.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	2.438.738	0,48
USD	150.000	CSX Corp. 3.80% 01/11/2046	150.902	0,03	USD	5.249.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	4.813.050	0,95
USD	726.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	735.578	0,14	USD	1.358.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	1.281.725	0,25
USD	721.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	819.083	0,16	USD	1.557.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	1.579.462	0,31
USD	925.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	972.513	0,19	USD	1.120.000	Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	999.848	0,19
EUR	995.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	863.962	0,17	USD	1.591.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	1.646.110	0,32
USD	760.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	796.496	0,16	GBP	3.600.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	4.978.133	0,97
USD	1.802.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	1.815.483	0,35	USD	312.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	310.830	0,06
USD	3.515.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	3.224.578	0,63	USD	3.028.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	3.062.373	0,60
USD	1.072.000	Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	1.050.550	0,20	USD	3.217.000	Morgan Stanley FRN 21/01/2033	3.015.022	0,59
USD	580.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	531.182	0,10	EUR	3.622.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	4.274.699	0,83
USD	1.597.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	1.462.581	0,29	EUR	1.443.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.748.752	0,34
USD	335.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	374.893	0,07	USD	925.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	944.338	0,18
EUR	700.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	774.323	0,15	USD	3.727.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	3.886.180	0,76
EUR	917.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	1.014.362	0,20	USD	1.992.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	1.819.444	0,36
EUR	584.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	653.933	0,13	USD	1.176.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	1.022.656	0,20
EUR	267.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.95% 21/05/2039	315.600	0,06	USD	1.200.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	1.046.680	0,20
EUR	350.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	462.256	0,09	USD	3.042.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	2.895.998	0,56
					USD	640.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	573.244	0,11
					USD	524.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	507.079	0,10
					USD	1.639.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	1.536.231	0,30

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>KANADA</b>					
USD	726.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	769.207	0,15	CAD	3.300.000	Canada (Govt of) 1.00% 01/09/2026	2.490.091	0,49
EUR	2.263.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	2.388.572	0,47	CAD	2.250.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	1.927.824	0,38
USD	1.565.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	1.578.709	0,31	<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>4.417.915</b>	<b>0,87</b>
USD	1.043.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	1.104.217	0,22	<b>DEUTSCHLAND</b>				
USD	460.000	Southern California Edison Company 3.65% 01/02/2050	427.030	0,08	EUR	5.710.000	Germany (Govt of) 0.00% 10/10/2025	6.307.043	1,22
USD	654.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	643.807	0,13	EUR	313.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	343.029	0,07
EUR	1.105.000	Southern Company FRN 15/09/2081	1.097.611	0,21	EUR	1.290.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	1.203.472	0,23
USD	747.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	767.842	0,15	EUR	2.780.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.00% 15/09/2028	2.938.015	0,57
EUR	615.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	619.180	0,12	GBP	6.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.00% 15/12/2022	7.899.307	1,54
GBP	1.300.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	1.942.154	0,38	<b>Deutschland, insgesamt</b>			<b>18.690.866</b>	<b>3,63</b>
USD	934.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	854.943	0,17	<b>JAPAN</b>				
USD	1.440.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	1.236.116	0,24	JPY	200.000.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	1.451.782	0,28
USD	566.000	Tsmc Arizona Corp. 2.50% 25/10/2031	523.904	0,10	<b>Japan, insgesamt</b>			<b>1.451.782</b>	<b>0,28</b>
USD	1.955.000	Verizon Communications Inc. 2.65% 20/11/2040	1.667.516	0,33	<b>SUPRANATIONAL</b>				
USD	1.461.000	Verizon Communications Inc. 3.70% 22/03/2061	1.370.561	0,27	USD	13.000.000	European Investment Bank 2.38% 15/06/2022	13.015.115	2,54
USD	3.401.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	3.631.176	0,70	EUR	2.300.000	IBRD 0.00% 15/01/2027	2.456.547	0,48
USD	763.000	Williams Cos Inc. 3.50% 15/10/2051	670.905	0,13	USD	4.000.000	IBRD 0.75% 24/11/2027	3.624.424	0,71
USD	1.136.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	1.216.683	0,24	USD	5.465.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	5.190.235	1,01
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>150.109.516</b>	<b>29,26</b>	<b>Supranational, insgesamt</b>			<b>24.286.321</b>	<b>4,74</b>
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
USD	1.572.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	1.706.469	0,33	GBP	3.382.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	3.833.733	0,75
<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>			<b>1.706.469</b>	<b>0,33</b>	GBP	239.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/10/2041	284.498	0,06
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>364.921.615</b>	<b>71,13</b>	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>4.118.231</b>	<b>0,81</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>						
USD	2.600.000	United States Treasury N/B 0.38% 15/07/2024	2.482.188	0,48	USD	1.289.000	Credit Agricole SA Perp FRN	1.171.289	0,23	
USD	1.500.000	United States Treasury N/B 0.38% 30/09/2027	1.339.688	0,26			<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>4.738.873</b>	<b>0,92</b>	
USD	6.822.000	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	5.363.263	1,05	<b>ITALIEN</b>					
USD	5.493.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	4.100.009	0,80	USD	300.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	291.175	0,06	
USD	691.000	United States Treasury N/B 2.00% 15/11/2041	626.381	0,12			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>291.175</b>	<b>0,06</b>	
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>13.911.529</b>	<b>2,71</b>	<b>NIEDERLANDE</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>66.876.644</b>	<b>13,04</b>	USD	249.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	312.521	0,06
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>431.798.259</b>	<b>84,17</b>	USD	409.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	419.701	0,08
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>								<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>732.222</b>	<b>0,14</b>
<b>Anleihen</b>						<b>NORWEGEN</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>						USD	2.117.000	DNB Bank ASA 1.13% 16/09/2026	1.943.645	0,38
USD	1.347.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	1.383.437	0,27			<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>1.943.645</b>	<b>0,38</b>	
USD	4.378.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	4.522.845	0,89	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
		<b>Australien, insgesamt</b>	<b>5.906.282</b>	<b>1,16</b>	USD	879.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	811.241	0,16	
<b>KANADA</b>						USD	1.701.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	1.581.812	0,31
USD	655.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	650.108	0,13	USD	5.013.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	4.716.425	0,92	
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>650.108</b>	<b>0,13</b>	USD	568.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	629.074	0,12	
<b>DÄNEMARK</b>						USD	1.912.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	1.784.038	0,35
USD	4.527.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	4.123.681	0,80	USD	2.726.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	2.796.286	0,55	
		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>4.123.681</b>	<b>0,80</b>	USD	2.589.000	Magallanes Inc. 5.39% 15/03/2062	2.683.553	0,52	
<b>FRANKREICH</b>						USD	1.406.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	1.462.337	0,29
USD	2.384.000	BNP Paribas SA FRN 15/09/2029	2.125.721	0,41	USD	3.000.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	2.587.713	0,50	
USD	1.516.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.441.863	0,28	USD	493.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	513.294	0,10	
					USD	394.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	387.496	0,08	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
USD	3.530.000			USD	1.833.000		
	Northwestern Mutual L 3.45%				Broadcom Inc. 2.45%		
	30/03/2051	3.222.684	0,64		15/02/2031	1.629.861	0,32
USD	308.000				<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.629.861</b>	<b>0,32</b>
	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The 3.63%			<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>4.241.699</b>	<b>0,83</b>
	30/09/2059	281.579	0,05	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>		<b>4.241.699</b>	<b>0,83</b>
USD	495.000						
	Peachtree Fund Trust 3.98%	502.006	0,10	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
USD	2.322.000			<b>Fonds</b>			
	Roche Holdings Inc. 1.93%	2.162.488	0,42	<b>IRLAND</b>			
USD	889.000				10.006.758		
	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90%	985.804	0,19		BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	10.006.758	1,95
USD	2.267.000				<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.006.758</b>	<b>1,95</b>
	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27%	2.416.364	0,47	<b>Fonds, insgesamt</b>		<b>10.006.758</b>	<b>1,95</b>
USD	824.000			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>		<b>10.006.758</b>	<b>1,95</b>
	T-Mobile USA Inc. 3.60%	703.893	0,14	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>		<b>494.660.789</b>	<b>96,45</b>
	15/11/2060			<b>(Gesamtkosten: USD 537.909.310)</b>			
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>30.228.087</b>	<b>5,91</b>				
<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>48.614.073</b>	<b>9,50</b>				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>		<b>48.614.073</b>	<b>9,50</b>				

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen

##### KANADA

CAD	1.980.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	1.568.514	0,31
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>1.568.514</b>	<b>0,31</b>

##### FRANKREICH

USD	1.100.000	BNP Paribas SA FRN 20/01/2033	1.018.846	0,20
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>1.018.846</b>	<b>0,20</b>

##### PORTUGAL

EUR	200.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	24.478	0,00
		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>24.478</b>	<b>0,00</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>DÄNEMARK (Fortsetzung)</b>						
EUR	423.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033	371.938	0,29	EUR	157.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	148.133	0,12	
EUR	239.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	210.651	0,16	<b>Dänemark, insgesamt</b>					
EUR	312.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031	274.993	0,22			<b>884.175</b>	<b>0,70</b>		
EUR	1.588.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025	1.583.908	1,24	<b>FINNLAND</b>					
EUR	544.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030	485.712	0,38	EUR	1.521.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	1.410.763	1,10	
EUR	600.000	Australia & New Zealand Banking Group Limited FRN 05/05/2031	563.986	0,44	<b>Finnland, insgesamt</b>					
EUR	1.072.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025	1.071.555	0,84			<b>1.410.763</b>	<b>1,10</b>		
<b>Australien, insgesamt</b>				<b>4.562.743</b>	<b>3,57</b>	<b>FRANKREICH</b>				
<b>BELGIEN</b>					EUR	400.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.01% 07/03/2025	388.734	0,30	
EUR	926.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	1.116.427	0,88	EUR	900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	831.450	0,65	
EUR	162.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040	195.315	0,15	EUR	600.000	BNP Paribas SA FRN 11/07/2030	555.519	0,44	
EUR	600.000	Argenta Spaarbank NV FRN 08/02/2029	569.969	0,45	EUR	200.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	176.735	0,14	
EUR	400.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026	378.928	0,30	EUR	800.000	BPCE SA FRN 13/10/2046	693.525	0,54	
EUR	400.000	Belfius Bank SA Perp FRN	363.154	0,28	EUR	500.000	CNP Assurances FRN 12/10/2053	441.932	0,35	
EUR	500.000	Belfius Bank SA/ NV 0.13% 08/02/2028	459.778	0,36	EUR	400.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	367.576	0,29	
EUR	500.000	Elia Transmission Belgium SA 0.88% 28/04/2030	464.769	0,36	EUR	600.000	Credit Agricole SA 1.00% 03/07/2029	578.838	0,45	
EUR	600.000	Elia Transmission Belgium SA 1.38% 27/05/2024	607.574	0,48	EUR	800.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029	783.735	0,61	
EUR	500.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027	465.353	0,36	EUR	300.000	Credit Mutuel Arkea SA 1.13% 23/05/2029	288.394	0,23	
<b>Belgien, insgesamt</b>				<b>4.621.267</b>	<b>3,62</b>	EUR	900.000	Danone SA 2.60% 28/06/2023	927.080	0,73
<b>BERMUDAS</b>					EUR	200.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	181.375	0,14	
USD	500.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	503.829	0,39	EUR	200.000	Electricite de France SA 2.00% 09/12/2049	182.869	0,14	
<b>Bermudas, insgesamt</b>				<b>503.829</b>	<b>0,39</b>	EUR	800.000	Electricite de France SA Perp FRN	718.646	0,56
<b>DÄNEMARK</b>					EUR	200.000	Elo Saca 3.25% 23/07/2027	201.587	0,16	
EUR	747.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	736.042	0,58	EUR	758.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	656.324	0,52	
					EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	94.627	0,07	
					EUR	1.100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.63% 08/07/2032	995.062	0,78	
					EUR	700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	635.816	0,50	
					EUR	2.100.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026	2.110.293	1,66	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>IRLAND (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.400.000	Schneider Electric SE 0.25% 09/09/2024	1.384.821	1,09	EUR	650.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	603.647	0,47
EUR	500.000	Societe Generale SA FRN 17/11/2026	478.523	0,37	EUR	198.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	181.840	0,14
EUR	600.000	TotalEnergies SE Perp FRN	551.316	0,43	EUR	565.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	555.416	0,43
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>14.224.777</b>	<b>11,15</b>			<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.573.061</b>	<b>2,01</b>
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>ITALIEN</b>					
EUR	1.600.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	1.546.555	1,21	EUR	241.000	Aeroporti di Roma SpA 1.63% 08/06/2027	236.980	0,19
EUR	700.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	657.719	0,52	EUR	214.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	196.239	0,15
EUR	900.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	757.201	0,59	EUR	283.000	Assicurazioni Generali SpA 5.00% 08/06/2048	311.419	0,24
EUR	600.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	497.457	0,39	EUR	420.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	410.108	0,33
EUR	686.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	678.295	0,53	EUR	149.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	145.059	0,11
EUR	700.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	717.383	0,56	EUR	358.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	336.594	0,26
EUR	823.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	828.842	0,65	EUR	211.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	192.101	0,15
EUR	900.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	842.436	0,66	EUR	195.000	Eni SpA Perp FRN	186.735	0,15
EUR	435.000	E.ON SE 0.13% 18/01/2026	417.472	0,33	EUR	194.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	185.200	0,15
EUR	500.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	437.100	0,34	EUR	309.000	Snam SpA 0.00% 15/08/2025	297.369	0,23
EUR	800.000	Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	699.359	0,55	EUR	450.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	430.798	0,34
EUR	700.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	711.857	0,56			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>2.928.602</b>	<b>2,30</b>
EUR	122.000	Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	121.229	0,09	<b>JAPAN</b>				
EUR	1.500.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	1.451.333	1,14	EUR	900.000	Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0.01% 10/09/2025	868.867	0,68
EUR	840.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.01% 05/05/2027	808.993	0,63			<b>Japan, insgesamt</b>	<b>868.867</b>	<b>0,68</b>
EUR	500.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	426.886	0,33	<b>JERSEY - KANALINSELN</b>				
EUR	100.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	106.998	0,08	EUR	315.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	286.290	0,22
EUR	115.000	Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	123.048	0,10	EUR	487.000	Heathrow Funding Limited 1.88% 14/03/2034	449.272	0,36
EUR	700.000	Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	575.295	0,45			<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>735.562</b>	<b>0,58</b>
EUR	500.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	496.607	0,39	<b>LUXEMBURG</b>				
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>12.902.065</b>	<b>10,10</b>	EUR	700.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	639.352	0,50
<b>IRLAND</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
EUR	886.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	866.534	0,68					
EUR	370.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	365.624	0,29					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	840.450	0,67	EUR	400.000	Iberdrola International BV Perp FRN	364.300	0,29
EUR	400.000	Aroundtown SA 1.63% 31/01/2028	383.063	0,30	EUR	300.000	ING Groep NV FRN 01/02/2030	268.557	0,21
EUR	110.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	97.099	0,08	EUR	400.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	371.284	0,29
EUR	953.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	785.352	0,61	EUR	300.000	ING Groep NV FRN 29/11/2030	277.919	0,22
EUR	600.000	Grand City Properties 0.13% 11/01/2028	525.733	0,41	EUR	600.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	590.037	0,46
EUR	924.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	824.212	0,64	EUR	1.695.000	Relx Finance 1.00% 22/03/2024	1.702.536	1,33
EUR	1.479.000	Novartis Finance SA 0.00% 23/09/2028	1.370.511	1,07	EUR	415.000	Royal Schiphol Group NV 0.75% 22/04/2033	374.470	0,29
EUR	910.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	834.086	0,66	EUR	480.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	421.812	0,33
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>6.299.858</b>	<b>4,94</b>	EUR	345.000	Shell International Finance BV 1.88% 07/04/2032	355.204	0,28
<b>MEXIKO</b>					EUR	618.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	573.842	0,45
EUR	300.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	278.669	0,22	EUR	1.163.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.121.518	0,88
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>278.669</b>	<b>0,22</b>	EUR	400.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	370.434	0,29
<b>NIEDERLANDE</b>					EUR	700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	726.280	0,57
EUR	260.000	Airbus SE 2.38% 07/04/2032	278.409	0,22	EUR	184.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	162.661	0,13
EUR	300.000	Airbus SE 2.38% 09/06/2040	306.670	0,24	EUR	798.000	Tennet Holding BV Perp FRN	801.214	0,63
EUR	461.000	Akelius Residential Property Financing BV 0.75% 22/02/2030	395.810	0,31	EUR	638.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	574.910	0,45
EUR	174.000	Akelius Residential Property Financing BV 1.13% 11/01/2029	157.415	0,12	EUR	500.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	472.347	0,37
EUR	400.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	382.808	0,30	EUR	466.000	Unilever Finance Netherlands BV 1.25% 28/02/2031	464.941	0,36
EUR	1.100.000	Allianz Finance II BV 0.25% 06/06/2023	1.102.964	0,86	EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.199.049	0,94
EUR	942.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	868.659	0,67			<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>17.699.652</b>	<b>13,85</b>
EUR	100.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	87.970	0,07	<b>NORWEGEN</b>				
EUR	345.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	303.496	0,24	EUR	1.250.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	1.139.966	0,89
EUR	500.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	502.189	0,39			<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>1.139.966</b>	<b>0,89</b>
EUR	482.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	438.777	0,34	<b>SPANIEN</b>				
EUR	1.038.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	944.917	0,74	EUR	400.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	352.694	0,28
EUR	790.000	Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	736.253	0,58			<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>352.694</b>	<b>0,28</b>
					<b>SCHWEDEN</b>				
					EUR	791.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	742.453	0,58
					EUR	566.000	Swedbank AB 0.25% 02/11/2026	539.269	0,42
							<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>1.281.722</b>	<b>1,00</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>SCHWEIZ</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	514.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	462.652	0,36	USD	898.000	Nationwide Building Society 1.50% 13/10/2026	744.622	0,58
EUR	1.136.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	923.422	0,72	EUR	670.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	618.136	0,48
EUR	803.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	731.633	0,57	USD	1.050.000	NatWest Markets plc 1.60% 29/09/2026	864.975	0,68
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>2.117.707</b>	<b>1,65</b>	EUR	1.020.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	954.510	0,75
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				EUR 700.000 Thames Water Utilities Finance 0.19% 23/10/2023				695.391	0,54
EUR	336.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	307.171	0,24	EUR	913.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	867.819	0,68
EUR	281.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	256.890	0,20	GBP	950.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	1.121.160	0,88
EUR	764.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	767.412	0,59	EUR	283.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	275.428	0,22
EUR	515.000	British American Tobacco plc Perp FRN	470.066	0,37	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>17.080.321</b>	<b>13,37</b>
EUR	779.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	705.633	0,55	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
EUR	170.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	153.989	0,12	EUR	2.214.000	AbbVie Inc. 0.75% 18/11/2027	2.121.199	1,67
EUR	252.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	223.819	0,18	EUR	453.000	American International Group Inc. 1.88% 21/06/2027	454.831	0,36
GBP	551.061	Delamare Finance plc 5.55% 19/02/2029	716.451	0,56	USD	245.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	239.858	0,19
EUR	400.000	Diageo Finance plc 0.50% 19/06/2024	398.805	0,31	EUR	317.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	292.949	0,23
EUR	430.000	Diageo Finance plc 1.00% 22/04/2025	431.611	0,34	EUR	571.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	525.603	0,41
EUR	432.000	DS Smith plc 0.88% 12.09.2026	411.939	0,32	EUR	200.000	AT&T Inc. 1.80% 14/09/2039	184.099	0,14
EUR	380.000	Glaxosmithkline Capital plc 0.00% 23/09/2023	378.643	0,30	EUR	537.000	AT&T Inc. 3.15% 04/09/2036	591.012	0,46
EUR	735.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	779.455	0,61	EUR	634.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	578.752	0,45
EUR	1.048.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.101.651	0,86	EUR	160.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	146.057	0,11
EUR	294.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	296.763	0,23	EUR	1.390.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	1.538.768	1,22
EUR	328.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	302.505	0,24	EUR	739.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	736.544	0,58
EUR	1.520.000	Motability Operations Group plc 1.63% 09/06/2023	1.548.627	1,21	EUR	140.000	Citigroup Inc. 1.25% 10/04/2029	135.406	0,11
EUR	550.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	490.212	0,38	EUR	278.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	216.949	0,17
EUR	368.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	327.996	0,26	EUR	185.000	Exxon Mobil Corp. 0.52% 26/06/2028	176.506	0,14
EUR	956.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	868.642	0,69	EUR	251.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	249.539	0,20
					EUR	458.000	Fidelity National Information Services Inc. 2.00% 21/05/2030	460.922	0,36
					EUR	343.000	Fiserv Inc. 1.63% 01/07/2030	332.230	0,26

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>SUPRANATIONAL (Fortsetzung)</b>						
EUR	585.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	536.134	0,42	EUR	1.100.000	European Investment Bank 0.00% 15/11/2027	1.055.470	0,83	
EUR	529.000	Goldman Sachs Group Inc. 1.00% 18/03/2033	469.247	0,37	EUR	1.390.000	IBRD 0.00% 15/01/2027	1.334.300	1,04	
EUR	510.000	Honeywell International Inc. 0.00% 10/03/2024	503.814	0,39	<b>Supranational, insgesamt</b>					
EUR	427.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	417.339	0,33	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					
EUR	706.000	JPMorgan Chase & Company FRN 17/02/2033	625.018	0,49	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					
EUR	865.000	JPMorgan Chase & Company FRN 23/03/2030	871.192	0,68	<b>118.675.157 92,94</b>					
EUR	605.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	619.074	0,48	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
EUR	1.439.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.526.369	1,19	<b>Anleihen</b>					
EUR	208.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	226.551	0,18	<b>DÄNEMARK</b>					
EUR	707.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	670.679	0,52	USD	509.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	416.710	0,33	
EUR	281.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	254.267	0,20	<b>Dänemark, insgesamt</b>					
EUR	484.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	437.922	0,34	<b>416.710 0,33</b>					
EUR	210.000	Verizon Communications Inc. 1.13% 19/09/2035	190.008	0,15	<b>FRANKREICH</b>					
USD	1.071.000	Verizon Communications Inc. 2.10% 22/03/2028	900.470	0,71	USD	930.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.60% 04/10/2026	773.307	0,61	
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				<b>17.229.308</b>	<b>13,51</b>	USD	1.600.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	1.367.686	1,07
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>109.695.608</b>	<b>85,91</b>	USD	293.000	Credit Agricole SA Perp FRN	239.288	0,19
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Frankreich, insgesamt</b>						
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>2.380.281 1,87</b>						
EUR	280.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	275.794	0,22	<b>ITALIEN</b>					
EUR	3.960.000	Germany (Govt of) 0.00% 16/04/2027	3.885.987	3,04	USD	500.000	Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	436.159	0,34	
EUR	1.440.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.05% 30/05/2024	1.434.647	1,12	<b>Italien, insgesamt</b>					
<b>Deutschland, insgesamt</b>				<b>5.596.428</b>	<b>4,38</b>	<b>436.159 0,34</b>				
<b>SUPRANATIONAL</b>				<b>NIEDERLANDE</b>						
EUR	1.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 0.00% 10/01/2024	993.351	0,78	USD	1.150.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	1.060.611	0,83	
				<b>Niederlande, insgesamt</b>						
				<b>1.060.611 0,83</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
----------	--------	------------------	----------------------------------------

**Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)**

#### Anleihen (Fortsetzung)

##### NORWEGEN

USD	2.250.000	DNB Bank ASA FRN 30/09/2025	1.912.832	1,51
<b>Norwegen, insgesamt</b>			<b>1.912.832</b>	<b>1,51</b>

<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>6.206.593</b>	<b>4,88</b>
----------------------------	------------------	-------------

**Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt**

	<b>6.206.593</b>	<b>4,88</b>
--	------------------	-------------

#### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

##### Anleihen

##### PORTUGAL

EUR	600.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	66.000	0,05
<b>Portugal, insgesamt</b>			<b>66.000</b>	<b>0,05</b>

##### VEREINIGTES KÖNIGREICH

EUR	350.000	Lehman Brothers UK Capital Funding III LP Perp 3.88%**	0	0,00
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>0</b>	<b>0,00</b>

<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>66.000</b>	<b>0,05</b>
----------------------------	---------------	-------------

<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>66.000</b>	<b>0,05</b>
----------------------------------------------------------------------------------	---------------	-------------

#### Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

##### Fonds

##### IRLAND

52	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	5.156	0,00
<b>Irland, insgesamt</b>		<b>5.156</b>	<b>0,00</b>

<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>5.156</b>	<b>0,00</b>
-------------------------	--------------	-------------

<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>5.156</b>	<b>0,00</b>
---------------------------------------------------------------------------------------	--------------	-------------

<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>124.952.906</b>	<b>97,87</b>
------------------------------------	--------------------	--------------

(Gesamtkosten: EUR 131.356.073)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	3.100.000	Belfius Bank SA Perp FRN	3.115.501	0,70	EUR	433.000	Chrome Bidco SASU 3.50% 31/05/2028	415.375	0,09
EUR	351.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	344.000	0,08	EUR	1.208.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	1.126.218	0,26
EUR	1.100.000	Solvay SA Perp FRN	1.035.070	0,24	EUR	51.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	55.234	0,01
EUR	300.000	Solvay SA Perp FRN	305.703	0,07	EUR	1.937.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	2.097.819	0,48
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>4.800.274</b>	<b>1,09</b>	EUR	3.106.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	2.861.057	0,65
<b>KANADA</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.189.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	1.110.387	0,25	EUR	1.115.000	Crown European Holdings SA 2.63% 30/09/2024	1.129.731	0,26
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>1.110.387</b>	<b>0,25</b>	EUR	587.000	Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026	596.253	0,14
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.350.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029	1.327.777	0,30	EUR	650.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	667.842	0,15
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.327.777</b>	<b>0,30</b>	EUR	2.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.976.277	0,46
<b>FINNLAND</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	531.000	Nokia Oyj 2.00% 11/03/2026	529.393	0,12	EUR	1.600.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.492.257	0,34
EUR	594.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	545.248	0,12	EUR	400.000	Electricite de France SA Perp FRN	360.513	0,08
EUR	1.592.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	1.583.041	0,36	EUR	2.900.000	Electricite de France SA Perp FRN	2.973.550	0,69
		<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>2.657.682</b>	<b>0,60</b>	EUR	1.800.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.873.564	0,44
<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	600.000	Accor SA Perp FRN	604.097	0,14	GBP	1.200.000	Electricite de France SA Perp FRN	1.408.071	0,32
EUR	1.165.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028	1.059.366	0,24	EUR	1.216.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	1.112.165	0,25
EUR	542.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	489.110	0,11	EUR	1.100.000	Elis SA 1.00% 03/04/2025	1.065.946	0,24
EUR	561.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	510.407	0,12	EUR	846.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028	798.326	0,18
EUR	1.364.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	1.241.006	0,28	EUR	4.284.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027	3.833.586	0,89
EUR	1.181.000	Altice France SA 5.88% 01/02/2027	1.211.266	0,28	EUR	100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	86.586	0,02
EUR	1.542.000	CAB Selas 3.38% 01/02/2028	1.469.996	0,34	EUR	1.785.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	1.635.823	0,37
EUR	600.000	Casino Guichard Perrachon SA 4.05% 05/08/2026	511.663	0,12	EUR	1.059.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	997.914	0,23
EUR	1.115.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	953.736	0,22	EUR	2.000.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	2.048.833	0,47
EUR	990.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	904.919	0,21	EUR	3.160.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	3.203.834	0,73
EUR	2.600.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	2.434.999	0,56	EUR	982.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	982.239	0,22
					EUR	500.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	484.607	0,11
					EUR	500.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024	487.349	0,11
					EUR	681.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	685.388	0,16
					EUR	571.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	525.306	0,12
					EUR	1.030.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	937.482	0,21
					EUR	578.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029	540.332	0,12
					EUR	1.379.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	1.360.471	0,31

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>			
EUR	628.000 Loxam SAS 3.75% 15/07/2026	622.158	0,14	EUR	2.600.000 Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	2.508.523	0,57
EUR	605.000 Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	591.965	0,14	EUR	1.190.000 Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	1.135.614	0,26
EUR	400.000 Orano SA 3.38% 23/04/2026	411.607	0,09	EUR	855.000 Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	849.594	0,19
EUR	100.000 Orano SA 4.88% 23/09/2024	108.486	0,02	EUR	804.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	783.914	0,18
EUR	754.000 Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	720.224	0,16	EUR	902.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	879.466	0,20
EUR	1.393.000 Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	1.405.201	0,32	EUR	2.015.000 HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	2.018.400	0,46
EUR	1.438.000 Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	1.486.993	0,33	EUR	548.360 IHO Verwaltungs GmbH 3.75% 15/09/2026	533.260	0,12
EUR	1.219.000 Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	1.186.641	0,27	EUR	530.000 Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	482.898	0,11
EUR	500.000 Renault SA 1.25% 24/06/2025	466.233	0,11	EUR	500.000 Infineon Technologies AG Perp FRN	501.657	0,11
EUR	500.000 Renault SA 2.00% 28/09/2026	460.438	0,11	EUR	600.000 Infineon Technologies AG Perp FRN	602.068	0,14
EUR	1.300.000 Renault SA 2.38% 25/05/2026	1.227.981	0,28	EUR	1.500.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.280.658	0,29
EUR	500.000 Renault SA 2.50% 02/06/2027	461.634	0,11	EUR	990.000 Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	952.109	0,22
EUR	700.000 Renault SA 2.50% 01/04/2028	626.267	0,14	EUR	2.694.000 Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.569.777	0,59
EUR	850.000 Rexel SA 2.13% 15/06/2028	814.581	0,19	EUR	2.556.000 PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	2.464.656	0,57
EUR	961.000 Rexel SA 2.13% 15/12/2028	909.955	0,21	EUR	1.566.000 Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	1.552.869	0,35
EUR	1.979.000 Solvay Finance SA Perp FRN	2.065.788	0,47	EUR	434.000 Progroup AG 3.00% 31/03/2026	417.378	0,10
EUR	1.100.000 Spie SA 2.63% 18/06/2026	1.095.333	0,25	EUR	900.000 Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	905.359	0,21
EUR	3.000.000 Valeo 1.00% 03/08/2028	2.624.046	0,60	EUR	2.100.000 Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	2.112.504	0,48
EUR	500.000 Valeo SA 1.50% 18/06/2025	488.784	0,11	EUR	1.314.000 Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	1.296.471	0,30
EUR	600.000 Valeo SA 1.63% 18/03/2026	582.657	0,13	EUR	800.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	785.056	0,18
EUR	300.000 Valeo SA 3.25% 22/01/2024	310.016	0,07	EUR	700.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	686.924	0,16
EUR	1.100.000 Veolia Environnement SA Perp FRN	1.072.802	0,25	EUR	1.575.000 Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	1.562.560	0,36
EUR	1.500.000 Verallia SA 1.63% 14/05/2028	1.401.731	0,32	EUR	1.536.000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	1.480.265	0,34
EUR	1.700.000 Verallia SA 1.88% 10/11/2031	1.503.137	0,34	EUR	1.247.582 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	1.251.908	0,29
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>73.855.171</b>	<b>16,89</b>	EUR	1.002.000 thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	999.608	0,23
				EUR	1.568.000 Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.565.465	0,36
				EUR	1.340.000 TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	1.326.297	0,30
<b>DEUTSCHLAND</b>							
EUR	1.100.000 Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.045.861	0,24				
EUR	550.000 Adler Real Estate AG 2.13% 06/02/2024	505.184	0,12				
EUR	1.701.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	1.654.343	0,37				
EUR	263.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	260.389	0,06				
EUR	598.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	592.064	0,14				
EUR	500.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	492.282	0,11				
EUR	2.800.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	2.609.461	0,60				
EUR	2.200.000 Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	2.123.128	0,49				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>			
EUR	62.000 TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	61.366	0,01	EUR	2.624.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	2.504.973	0,57
EUR	100.000 ZF Finance GmbH 2.75% 25/05/2027	93.227	0,02	EUR	939.000 Nexi SpA 2.13% 30/04/2029	855.838	0,20
EUR	900.000 ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	885.847	0,20	EUR	1.000.000 Telecom Italia SpA 2.38% 12/10/2027	914.340	0,21
EUR	1.100.000 ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	1.047.503	0,24	EUR	1.802.000 Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	1.772.143	0,41
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>44.875.913</b>	<b>10,27</b>	EUR	275.000 Telecom Italia SpA 2.88% 28/01/2026	265.430	0,06
				EUR	1.443.000 Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	1.441.913	0,33
<b>IRLAND</b>				EUR	1.064.000 Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	1.092.839	0,25
EUR	3.436.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	3.393.479	0,78	EUR	600.000 Telecom Italia SpA 5.25% 17/03/2025	588.343	0,13
GBP	826.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	924.668	0,21	GBP	1.050.000 Telecom Italia SpA 5.88% 19/05/2023	1.274.220	0,29
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>4.318.147</b>	<b>0,99</b>	EUR	950.000 Unipol Gruppo SpA 3.25% 23/09/2030	974.900	0,22
<b>INSEL MAN</b>				<b>Italien, insgesamt</b>			
EUR	1.157.000 Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.163.364	0,27			<b>27.640.439</b>	<b>6,32</b>
EUR	484.000 Playtech plc 4.25% 07/03/2026	486.469	0,11	<b>JAPAN</b>			
	<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>1.649.833</b>	<b>0,38</b>	EUR	716.000 Softbank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	640.152	0,15
<b>ITALIEN</b>				EUR	1.046.000 Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	984.262	0,22
EUR	1.664.000 Atlantia SpA 1.63% 03/02/2025	1.643.189	0,38	EUR	630.000 Softbank Group Corp. 4.00% 20/04/2023	632.201	0,14
EUR	1.922.000 Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	1.837.245	0,41	EUR	607.000 Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	531.257	0,12
EUR	2.456.000 Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	2.327.670	0,53	EUR	1.148.000 Softbank Group Corp. 5.00% 15/04/2028	1.092.418	0,25
EUR	609.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	554.454	0,13	<b>Japan, insgesamt</b>			
EUR	1.423.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 2.63% 28/04/2025	1.344.059	0,31			<b>3.880.290</b>	<b>0,88</b>
EUR	826.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3.63% 24/09/2024	800.215	0,18	<b>JERSEY - KANALINSELN</b>			
EUR	1.607.000 Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	1.530.755	0,35	EUR	1.667.000 Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.640.510	0,38
EUR	522.000 Gamma Bidco SpA 6.25% 15/07/2025	528.215	0,12	EUR	3.012.000 Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	3.033.328	0,69
EUR	1.584.000 IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	1.487.949	0,34	EUR	1.149.000 Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	1.125.407	0,26
EUR	388.000 Infrastrutture Wireless Italiane SpA 1.88% 08/07/2026	383.030	0,09	<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>			
EUR	771.000 International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	778.963	0,18			<b>5.799.245</b>	<b>1,33</b>
EUR	378.000 Leonardo SpA 1.50% 07/06/2024	379.144	0,09	<b>LUXEMBURG</b>			
EUR	607.000 Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	614.313	0,14	EUR	1.900.000 Adler Group SA 1.88% 14/01/2026	1.591.158	0,36
EUR	540.000 Leonardo SpA 4.88% 24/03/2025	586.085	0,13	EUR	200.000 Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	167.981	0,04
EUR	1.191.000 Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	1.160.214	0,27				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>			
EUR	1.900.000 Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	1.679.349	0,38	EUR	579.000 Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	550.011	0,13
EUR	910.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	869.822	0,20	EUR	1.562.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	1.535.378	0,35
EUR	1.393.000 Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	1.231.535	0,28	EUR	458.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	527.983	0,12
EUR	1.710.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	1.503.654	0,35	EUR	1.100.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	1.077.508	0,25
EUR	100.000 Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	86.147	0,02		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>34.945.137</b>	<b>8,00</b>
EUR	3.229.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	3.339.228	0,77		<b>NIEDERLANDE</b>		
EUR	1.335.261 ARD Finance SA 5.00% 30/06/2027	1.216.884	0,28	EUR	1.300.000 Abertis Finance BV Perp FRN	1.197.478	0,27
GBP	564.000 B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	654.570	0,15	EUR	1.937.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	1.792.011	0,41
GBP	980.000 B&m European Value Retail SA 4.00% 15/11/2028	1.090.481	0,25	EUR	1.317.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	1.328.526	0,30
EUR	1.091.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	1.006.919	0,23	EUR	562.000 Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	581.652	0,13
EUR	604.000 Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	573.176	0,13	EUR	200.000 Dufry One BV 2.50% 15/10/2024	195.104	0,04
EUR	657.000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	645.116	0,15	EUR	572.000 Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	531.601	0,12
EUR	1.790.900 Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	1.802.399	0,41	EUR	120.000 Goodyear Europe BV 2.75% 15/08/2028	108.683	0,02
EUR	543.000 CPI Property Group SA Perp FRN	506.234	0,12	EUR	1.991.000 Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	1.992.307	0,45
EUR	971.105 CPI Property Group SA Perp FRN	953.049	0,22	EUR	1.207.000 Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	1.252.127	0,29
EUR	639.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	637.751	0,15	EUR	1.548.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	1.382.699	0,31
GBP	1.057.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	1.245.155	0,28	EUR	370.800 Oci NV 3.63% 15/10/2025	377.260	0,09
EUR	1.384.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	1.418.622	0,32	EUR	300.000 Phoenix Pib Dutch Finance BV 2.38% 05/08/2025	294.434	0,07
EUR	612.000 Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	614.252	0,14	EUR	624.000 Ppf Telecom Group BV 2.13% 31/01/2025	610.061	0,14
EUR	479.000 HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	454.962	0,10	EUR	600.000 PPF Telecom Group BV 3.13% 27/03/2026	593.438	0,14
EUR	3.775.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	3.474.952	0,80	EUR	459.000 PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	449.848	0,10
EUR	900.000 Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	756.000	0,17	EUR	612.000 PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	621.725	0,14
EUR	1.173.792 Lhmc Finco 2 Sarl 7.25% 02/10/2025	1.148.199	0,26	EUR	722.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	680.059	0,16
EUR	1.914.000 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	1.917.007	0,44	EUR	212.000 Q-Park Holding I BV 2.00% 01/03/2027	194.138	0,04
EUR	684.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	669.655	0,15	EUR	837.000 Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	872.471	0,20
				EUR	2.565.000 Repsol International Finance BV Perp FRN	2.435.812	0,57

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>PANAMA</b>					
EUR	462.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	466.650	0,11	EUR	2.468.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	2.531.798	0,58
EUR	1.352.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.365.606	0,31			<b>Panama, insgesamt</b>	<b>2.531.798</b>	<b>0,58</b>
EUR	1.557.000	Repsol International Finance BV Perp FRN	1.567.569	0,36	<b>PORTUGAL</b>				
EUR	472.000	Saipem Finance International BV 3.13% 31/03/2028	404.530	0,09	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	632.500	0,14
EUR	603.000	Saipem Finance International BV 3.38% 15/07/2026	543.912	0,13	EUR	700.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 20/07/2080	670.208	0,15
EUR	1.008.697	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	1.007.030	0,23	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	104.051	0,02
EUR	857.253	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	855.837	0,20			<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>1.406.759</b>	<b>0,31</b>
EUR	1.100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.018.694	0,23	<b>RUMÄNIEN</b>				
EUR	1.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.203.911	0,28	EUR	1.100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	1.057.762	0,24
EUR	3.200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.237.977	0,74	EUR	400.000	RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028	368.136	0,08
EUR	3.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.838.906	0,89			<b>Rumänien, insgesamt</b>	<b>1.425.898</b>	<b>0,32</b>
EUR	1.100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.169.892	0,27	<b>SPANIEN</b>				
EUR	1.763.000	Tennet Holding BV Perp FRN	1.770.100	0,41	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	939.338	0,21
EUR	495.000	Tennet Holding BV Perp FRN	506.551	0,12	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	998.541	0,23
EUR	525.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 1.88% 31/03/2027	463.358	0,11	EUR	1.400.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	1.225.972	0,28
EUR	1.518.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	1.438.689	0,33	EUR	1.100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	1.002.755	0,23
EUR	1.434.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	1.335.075	0,31	EUR	700.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	694.799	0,16
EUR	515.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	520.096	0,12	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.00% 20/04/2027	459.836	0,11
EUR	1.287.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	1.205.358	0,28	EUR	500.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	453.908	0,10
EUR	966.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	905.359	0,21	EUR	600.000	Cellnex Telecom SA 2.88% 18/04/2025	620.034	0,14
EUR	641.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	641.210	0,15	EUR	2.105.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	2.006.811	0,45
EUR	691.000	United Group BV 5.25% 01/02/2030	647.539	0,15	EUR	1.733.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	1.659.114	0,37
EUR	1.075.000	VZ Secured Financing BV Bond 3.50% 15/01/2032	991.281	0,23	EUR	1.032.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.028.414	0,24
EUR	917.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	830.200	0,19	EUR	991.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	932.378	0,21
EUR	600.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	537.338	0,12	EUR	3.927.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.794.202	0,87
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>45.964.102</b>	<b>10,56</b>			<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>15.816.102</b>	<b>3,60</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>SCHWEDEN</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
EUR	1.540.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.305.594	0,30	EUR	1.367.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	1.346.500	0,31
EUR	720.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	605.096	0,14	USD	1.951.285	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	1.726.808	0,39
EUR	850.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	803.399	0,18	EUR	1.803.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	1.722.937	0,39
EUR	1.520.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	1.385.742	0,32	EUR	474.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	466.071	0,11
EUR	1.514.000	Intrum AB 3.00% 15/09/2027	1.395.679	0,32	EUR	396.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	389.376	0,09
EUR	1.733.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	1.666.280	0,38	EUR	98.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	92.846	0,02
EUR	478.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	482.556	0,11	EUR	2.215.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	2.098.501	0,47
EUR	2.033.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.913.859	0,44	GBP	1.458.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	1.746.907	0,39
EUR	80.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	75.312	0,02	EUR	1.583.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	1.480.638	0,34
EUR	586.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	573.973	0,13	EUR	1.306.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.336.888	0,31
EUR	2.069.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	1.915.226	0,44	EUR	2.025.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.044.030	0,47
EUR	138.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	127.743	0,03	GBP	2.284.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	2.695.228	0,62
EUR	322.000	Volvo Car AB 2.13% 02/04/2024	326.193	0,07	EUR	320.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	310.060	0,07
EUR	706.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	708.817	0,16	GBP	987.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.159.666	0,27
EUR	699.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	701.789	0,16	EUR	102.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	92.516	0,02
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>13.987.258</b>	<b>3,20</b>	EUR	602.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	614.168	0,14
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					EUR	1.880.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	1.935.486	0,44
GBP	868.000	Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	1.030.565	0,24	GBP	578.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	660.760	0,15
EUR	1.791.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	1.718.463	0,39	GBP	1.502.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	1.716.874	0,39
GBP	2.037.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	1.966.045	0,45	GBP	1.241.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	1.441.396	0,33
EUR	997.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.001.451	0,23	GBP	600.000	Marks & Spencer plc 6.00% 12/06/2025	742.491	0,17
EUR	686.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	678.034	0,15	EUR	896.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	901.775	0,21
GBP	510.000	Centrica plc FRN 10/04/2075	612.895	0,14	GBP	1.429.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	1.693.273	0,39
GBP	911.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	988.282	0,23	GBP	2.315.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	2.701.861	0,62
GBP	1.026.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	1.214.113	0,28	EUR	523.000	Rolls-Royce plc 4.63% 16/02/2026	550.472	0,13
GBP	935.000	Co-Operative Group Holdings FRN 08/07/2026	1.177.319	0,27					
GBP	621.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	738.094	0,17					
GBP	2.270.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	2.571.686	0,58					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
GBP	514.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	635.423	0,14	EUR	565.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	545.068	0,12
GBP	1.377.000	Santander UK plc Perp 10.06%	2.865.728	0,65	EUR	1.054.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.74% 19/07/2024	1.037.716	0,24
EUR	2.065.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	1.974.740	0,44	EUR	1.599.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	1.572.843	0,36
EUR	808.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	811.770	0,19	EUR	271.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	266.256	0,06
GBP	739.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	868.703	0,20	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	285.906	0,07
EUR	829.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	799.265	0,18	EUR	291.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	285.906	0,07
EUR	1.703.000	Victoria plc 3.75% 15/03/2028	1.576.410	0,36	GBP	1.323.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	1.519.416	0,35
GBP	603.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	656.286	0,15	EUR	2.513.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	2.547.202	0,57
GBP	1.466.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.00% 15/04/2027	1.759.197	0,40	EUR	1.830.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	1.860.599	0,43
GBP	409.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	476.306	0,11	EUR	952.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.128.979	0,26
EUR	1.860.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	1.719.664	0,39	GBP	952.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	1.128.979	0,26
EUR	876.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	852.562	0,19	EUR	2.761.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	2.628.334	0,60
EUR	1.646.000	Vodafone Group plc FRN 03/01/2079	1.662.503	0,38	EUR	139.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	127.758	0,03
EUR	1.909.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.953.177	0,45	EUR	2.532.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	2.327.216	0,54
GBP	335.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	401.932	0,09	EUR	1.236.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	1.195.305	0,27
USD	1.727.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	1.602.211	0,37	EUR	586.000	MPT Operating Partnership 3.33% 24/03/2025	606.530	0,13
USD	1.024.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	1.020.268	0,23	GBP	748.000	MPT Operating Partnership 3.69% 05/06/2028	861.567	0,20
USD	56.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	55.796	0,01	EUR	2.841.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	3.040.511	0,69
GBP	2.815.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	3.067.232	0,70	EUR	360.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	381.857	0,09
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>70.123.648</b>	<b>16,00</b>	EUR	666.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	753.752	0,17
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					USD	430.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	380.841	0,09
EUR	1.800.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	1.663.435	0,37	USD	590.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	563.872	0,13
EUR	333.000	Ardagh Metal Packaging 3.00% 01/09/2029	297.757	0,07	USD	310.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	314.486	0,07
EUR	1.663.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	1.686.696	0,38	USD	718.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	741.296	0,17
EUR	500.000	Avantor Funding Inc. 3.88% 15/07/2028	503.217	0,12	USD	550.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	555.351	0,13
EUR	1.785.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	1.675.448	0,38	USD	345.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	368.160	0,08
					USD	850.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	984.479	0,22
					EUR	1.184.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	1.090.513	0,25
					EUR	460.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	404.054	0,09
					EUR	1.444.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	1.485.515	0,34

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	1.330.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	1.325.782	0,30	GBP	584.000	Bracken Midco1 plc 6.75% 01/11/2027	667.437	0,15	
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>36.727.717</b>	<b>8,37</b>	GBP	3.281.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	3.761.472	0,85	
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>394.843.577</b>	<b>90,24</b>	GBP	297.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	329.919	0,08	
		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>394.843.577</b>	<b>90,24</b>	GBP	1.089.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	1.224.411	0,28	
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			GBP	885.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.13% 15/08/2030	961.549	0,22	
		<b>Anleihen</b>			GBP	1.919.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	2.094.104	0,48	
		<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>13.640.147</b>	<b>3,11</b>	
USD	445.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	430.442	0,10			<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>14.663.147</b>	<b>3,35</b>	
USD	478.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	537.006	0,12			<b>Aktien</b>			
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>967.448</b>	<b>0,22</b>			<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>967.448</b>	<b>0,22</b>			434	NV Profit Share Limited**	0	0,00
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>967.448</b>	<b>0,22</b>			<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	
		<b>Anleihen</b>					<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>14.663.147</b>	<b>3,35</b>	
		<b>PORTUGAL</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
EUR	1.000.000	Banco Espirito Santo SA 2.63% 31/12/2049**	110.000	0,03			<b>Fonds</b>			
EUR	6.900.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	759.000	0,17			<b>IRLAND</b>			
EUR	1.400.000	Banco Espirito Santo SA 4.75% 15/01/2023**	154.000	0,04			1.751.211	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.072.288	0,47
		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>1.023.000</b>	<b>0,24</b>			197.655	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	19.414.920	4,44
		<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					1.009.757	Insight Liquidity Funds plc	1.194.892	0,27
EUR	1.244.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	1.134.897	0,26			<b>Irland, insgesamt</b>	<b>22.682.100</b>	<b>5,18</b>	
GBP	3.162.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	3.466.358	0,79			<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>22.682.100</b>	<b>5,18</b>	
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>22.682.100</b>	<b>5,18</b>	
		<b>Anleihen</b>					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>433.156.272</b>	<b>98,99</b>	
		<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>(Gesamtkosten: EUR 449.402.373)</b>			
		<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>								

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>BELGIEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	300.000	House of Finance NV 4.38% 15/07/2026	294.017	0,27	EUR	569.000	La Financiere Atalian SASU 4.00% 15/05/2024	523.466	0,48	
<b>Belgien, insgesamt</b>				<b>294.017</b>	<b>0,27</b>	EUR	381.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	375.881	0,35
<b>DÄNEMARK</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	150.000	Dkt Finance Aps 7.00% 17/06/2023	150.967	0,14	EUR	177.178	Loxam SAS 6.00% 15/04/2025	178.327	0,16	
<b>Dänemark, insgesamt</b>				<b>150.967</b>	<b>0,14</b>	EUR	100.000	Orano SA 3.13% 20/03/2023	101.712	0,09
<b>FINNLAND</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	540.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.13% 04/02/2025	542.304	0,50	EUR	820.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	827.182	0,76	
<b>Finnland, insgesamt</b>				<b>542.304</b>	<b>0,50</b>	EUR	813.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	840.699	0,77
<b>FRANKREICH</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	316.000	Altice France SA 2.13% 15/02/2025	301.457	0,28	EUR	113.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	110.000	0,10	
EUR	1.356.000	Altice France SA 2.50% 15/01/2025	1.307.303	1,20	EUR	313.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	304.691	0,28	
EUR	610.000	Banijay Entertainment SASU 3.50% 01/03/2025	610.302	0,56	EUR	405.000	Quatrim SASU 5.88% 15/01/2024	405.976	0,37	
EUR	400.000	Casino Guichard Perrachon SA 1.87% 13/06/2022	400.588	0,37	EUR	300.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	308.284	0,29	
EUR	289.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	264.163	0,24	EUR	700.000	Valeo SA 3.25% 22/01/2024	723.370	0,67	
EUR	300.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	280.961	0,26	<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>15.545.509</b>	<b>14,32</b>	
EUR	505.000	CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026	546.927	0,51	<b>DEUTSCHLAND</b>					
EUR	147.000	Crown European Holdings SA 0.75% 15/02/2023	146.315	0,14	EUR	400.000	Adler Real Estate AG 1.50% 17/04/2022	396.349	0,37	
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 2.25% 01/02/2023	100.707	0,09	EUR	1.100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	1.045.861	0,97	
EUR	100.000	Crown European Holdings SA 3.38% 15/05/2025	102.745	0,09	EUR	250.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	243.143	0,22	
EUR	850.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	777.418	0,72	EUR	200.000	Demire Deutsche Mittelstand Real Estate AG 1.88% 15/10/2024	195.270	0,18	
EUR	500.000	Elis SA 1.88% 15/02/2023	504.170	0,46	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 1.63% 16/11/2023	298.234	0,28	
EUR	271.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	264.440	0,24	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.00% 14/07/2024	196.964	0,18	
EUR	1.291.000	Faurecia SE 2.63% 15/06/2025	1.259.752	1,17	EUR	400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	393.825	0,36	
EUR	250.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	229.107	0,21	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	279.585	0,26	
EUR	1.428.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	1.462.867	1,34	EUR	300.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	289.517	0,27	
EUR	1.006.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	1.019.955	0,94	EUR	726.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	721.409	0,67	
EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024	193.843	0,18	EUR	860.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	861.451	0,80	
EUR	799.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	804.148	0,75	EUR	1.000.000	IHO Verwaltungs GmbH 3.63% 15/05/2025	990.559	0,91	
EUR	280.000	Kapla Holding SAS 3.38% 15/12/2026	268.753	0,25	EUR	706.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	680.769	0,63	
					EUR	1.180.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	1.173.634	1,07	
					EUR	100.000	Progroup AG 3.00% 31/03/2026	96.170	0,09	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>					
EUR	100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	100.595	0,09	EUR	300.000	International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	303.098	0,28
EUR	979.000	Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	971.267	0,90	EUR	1.144.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.183.901	1,10
EUR	496.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	490.833	0,45	EUR	262.000	Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	255.228	0,24
EUR	1.230.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	1.185.369	1,09	EUR	428.000	Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	408.586	0,38
EUR	764.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	711.922	0,66	EUR	1.228.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	1.234.187	1,14
EUR	75.000	Thyssenkrupp AG 1.88% 06/03/2023	74.734	0,07	EUR	1.081.000	Rossini Sarl 6.75% 30/10/2025	1.110.244	1,03
EUR	1.009.000	Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	1.007.369	0,93	EUR	277.000	Telecom Italia SpA 2.50% 19/07/2023	280.361	0,26
EUR	500.000	TUI Cruises GmbH 6.50% 15/05/2026	474.979	0,44	EUR	100.000	Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	98.343	0,09
EUR	100.000	ZF Finance GmbH 3.00% 21/09/2025	98.427	0,09	EUR	500.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	513.552	0,47
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>12.978.235</b>	<b>11,98</b>			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>7.842.207</b>	<b>7,26</b>
<b>IRLAND</b>				<b>JAPAN</b>					
EUR	1.283.000	Eircom Finance Dac 1.75% 01/11/2024	1.269.590	1,18	EUR	500.000	Softbank Group Corp. 2.13% 06/07/2024	473.785	0,44
EUR	544.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	537.268	0,50	EUR	125.000	Softbank Group Corp. 4.00% 30/07/2022	124.805	0,12
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.806.858</b>	<b>1,68</b>	EUR	130.000	Softbank Group Corp. 4.00% 20/04/2023	130.454	0,12
<b>INSEL MAN</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
EUR	1.476.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	1.484.118	1,37	EUR	1.147.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	1.128.774	1,04
EUR	210.000	Playtech plc 4.25% 07/03/2026	211.071	0,19	EUR	664.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	668.687	0,62
		<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>1.695.189</b>	<b>1,56</b>	EUR	370.000	Avis Budget Finance plc 4.50% 15/05/2025	375.743	0,35
<b>ITALIEN</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN, insgesamt</b>					
GBP	150.000	Aeroporti di Roma SpA 5.44% 20/02/2023	182.109	0,17	EUR	233.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	228.216	0,21
EUR	575.000	Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 12/06/2023	577.489	0,53			<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>2.401.420</b>	<b>2,22</b>
EUR	400.000	Autostrade per l'Italia SpA 5.88% 09/06/2024	437.412	0,40	<b>LUXEMBURG</b>				
GBP	150.000	Autostrade per l'Italia SpA 6.25% 09/06/2022	178.854	0,17	EUR	750.000	Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	716.886	0,66
EUR	419.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	399.120	0,37	GBP	1.095.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	1.270.842	1,18
EUR	686.000	Gamma Bidco SpA 5.13% 15/07/2025	679.723	0,63	EUR	100.000	Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	98.191	0,09
					EUR	614.799	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	618.747	0,57
					EUR	214.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	210.021	0,19

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>			
EUR	590.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	588.846	0,54	EUR	246.000 Q-Park Holding I BV 1.50% 01/03/2025	231.710	0,21
GBP	143.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	168.455	0,16	EUR	500.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	504.947	0,47
EUR	350.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	358.756	0,33	EUR	650.000 United Group BV 3.13% 15/02/2026	608.766	0,56
EUR	493.000 HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	468.260	0,43	EUR	440.000 United Group BV 4.88% 01/07/2024	440.144	0,41
EUR	130.000 Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	109.200	0,10		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>5.354.475</b>	<b>4,94</b>
EUR	100.000 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	100.157	0,09				
EUR	800.000 Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	803.253	0,74		<b>PANAMA</b>		
EUR	375.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	371.701	0,34	EUR	200.000 Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	205.170	0,19
EUR	100.000 PLT VII Finance sarl 4.63% 05/01/2026	99.120	0,09	EUR	212.000 Carnival Corp. 10.13% 01/02/2026	237.356	0,22
EUR	322.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	316.512	0,29		<b>Panama, insgesamt</b>	<b>442.526</b>	<b>0,41</b>
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>6.298.947</b>	<b>5,80</b>				
					<b>RUMÄNIEN</b>		
				EUR	600.000 RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	576.961	0,53
					<b>Rumänien, insgesamt</b>	<b>576.961</b>	<b>0,53</b>
					<b>SPANIEN</b>		
EUR	385.000 Petroleos Mexicanos 2.50% 24/11/2022	385.409	0,36	EUR	200.000 Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	198.514	0,18
EUR	247.000 Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	247.969	0,23	EUR	300.000 Cellnex Telecom SA 2.38% 16/01/2024	306.955	0,28
	<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>633.378</b>	<b>0,59</b>	EUR	1.745.000 Gestamp Automocion SA 3.25% 30/04/2026	1.704.016	1,57
				EUR	150.000 Grifols SA 1.63% 15/02/2025	145.883	0,13
				EUR	1.920.000 Grifols SA 3.20% 01/05/2025	1.913.328	1,77
				EUR	500.000 Grupo Antolin-Irausa SA 3.38% 30/04/2026	439.281	0,41
				EUR	300.000 International Consolidated Airlines Group SA 2.75% 25/03/2025	286.561	0,26
					<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>4.994.538</b>	<b>4,60</b>
					<b>SCHWEDEN</b>		
				EUR	400.000 Intrum AB 3.13% 15/07/2024	398.070	0,37
				EUR	377.000 Intrum AB 4.88% 15/08/2025	380.594	0,35
				EUR	1.482.000 Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	1.483.066	1,38
					<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>2.261.730</b>	<b>2,10</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
GBP	300.000 Anglian Water Osprey Financing plc 5.00% 30/04/2023	363.027	0,34	GBP	736.300 Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	879.703	0,81	
GBP	879.000 Arqiva Broadcast Finance plc 6.75% 30/09/2023	1.043.625	0,96	GBP	235.000 Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 08/09/2023	283.656	0,26	
GBP	406.000 Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	391.858	0,36	GBP	200.000 Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	232.296	0,21	
GBP	245.000 Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	289.920	0,27	GBP	841.000 Marks & Spencer plc 4.25% 08/12/2023	1.004.060	0,93	
GBP	124.000 Co-Operative Group Holdings FRN 08/07/2026	156.136	0,14	EUR	594.000 OTE plc 2.38% 18/07/2022	597.460	0,55	
GBP	1.400.000 Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	1.663.982	1,55	EUR	304.000 Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	305.959	0,28	
EUR	289.000 EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	284.666	0,26	GBP	400.000 Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	473.975	0,44	
EUR	565.000 EG Global Finance plc 3.63% 07/02/2024	553.348	0,51	GBP	271.000 Premier Foods Finance plc 3.50% 15/10/2026	299.426	0,28	
USD	473.720 Enquest plc 7.00% 15/10/2023	419.222	0,39	GBP	369.000 Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	430.664	0,40	
GBP	580.000 GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	695.102	0,64	EUR	732.000 Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	700.005	0,66	
GBP	350.000 Heathrow Finance plc 5.25% 01/03/2024	408.510	0,38	EUR	400.000 Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	401.866	0,37	
GBP	366.000 Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	389.718	0,36	GBP	1.393.000 Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.674.862	1,55	
EUR	800.000 Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	764.477	0,71	GBP	100.000 Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	117.551	0,11	
EUR	100.000 Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	98.327	0,09	EUR	975.000 Victoria plc 3.63% 26/08/2026	940.029	0,87	
EUR	482.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	456.649	0,42	GBP	651.000 William Hill plc 4.88% 07/09/2023	776.249	0,72	
EUR	394.000 Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	373.277	0,34	GBP	128.000 WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	154.523	0,14	
GBP	357.000 Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	427.741	0,40	GBP	662.000 Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	721.317	0,67	
EUR	1.083.000 International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	1.108.614	1,03	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>23.139.459</b>	<b>21,41</b>
EUR	151.000 International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	152.419	0,14	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
GBP	900.000 Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	1.062.043	0,98	EUR	830.000 Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	841.827	0,78	
GBP	934.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	1.097.394	1,02	EUR	290.000 Ball Corp. 0.88% 15/03/2024	288.187	0,27	
EUR	140.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	142.830	0,13	EUR	515.000 Ball Corp. 4.38% 15/12/2023	544.618	0,50	
EUR	177.000 Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	182.224	0,17	EUR	404.000 Coty Inc. 4.00% 15/04/2023	404.670	0,37	
GBP	543.000 Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	620.749	0,57	EUR	200.000 Ford Motor Credit Company LLC 1.51% 17/02/2023	200.644	0,19	
				EUR	200.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	196.728	0,18	
				GBP	391.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	449.049	0,41	
				EUR	544.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	551.404	0,51	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Wandelanleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>SPANIEN</b>						
EUR	123.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	125.057	0,12	EUR	500.000	International Consolidated Airlines Group SA 0.63% 17/11/2022	492.750	0,45	
GBP	470.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	557.374	0,51	<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>492.750</b>	<b>0,45</b>	
EUR	464.000	Iqvia Inc. 1.75% 15/03/2026	453.502	0,42	<b>Wandelanleihen, insgesamt</b>				<b>835.405</b>	<b>0,77</b>
EUR	700.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/09/2025	704.524	0,65	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>99.184.828</b>	<b>91,60</b>
GBP	977.000	MPT Operating Partnership 2.55% 05/12/2023	1.144.782	1,06	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	248.486	0,23	<b>Anleihen</b>					
USD	160.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	161.557	0,15	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
USD	75.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	80.035	0,07	USD	260.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	251.494	0,23	
EUR	300.000	Scientific Games International Inc. 3.38% 15/02/2026	305.084	0,28	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>251.494</b>	<b>0,23</b>	
EUR	131.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	134.766	0,12	<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>251.494</b>	<b>0,23</b>
EUR	2.029.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	2.021.898	1,87	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>251.494</b>	<b>0,23</b>
EUR	1.000.000	ZF North America Capital 2.75% 27/04/2023	1.019.084	0,94	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>10.433.276</b>	<b>9,63</b>	<b>Anleihen</b>					
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>98.121.040</b>	<b>90,62</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>						
<b>FRANKREICH</b>				<b>Anleihen</b>						
EUR	228.571	Iqera Group SAS FRN 30/09/2024	228.383	0,21	GBP	520.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	570.053	0,53	
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>228.383</b>	<b>0,21</b>	GBP	1.775.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	2.034.932	1,89	
<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen, insgesamt</b>				<b>228.383</b>	<b>0,21</b>	GBP	178.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	200.133	0,18
<b>Wandelanleihen</b>				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				<b>3.584.664</b>	<b>3,32</b>	
<b>FRANKREICH</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>3.584.664</b>	<b>3,32</b>	
EUR	10.988	Elis SA 0.00% 06/10/2023	342.655	0,32	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				<b>3.584.664</b>	<b>3,32</b>
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>342.655</b>	<b>0,32</b>						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
19.434	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.908.927	1,76
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.908.927</b>	<b>1,76</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>1.908.927</b>	<b>1,76</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>1.908.927</b>	<b>1,76</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>104.929.913</b>	<b>96,91</b>

(Gesamtkosten: EUR 107.038.786)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	400.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	365.238	0,09	EUR	1.500.000	Air Liquide Finance SA 0.38% 27/05/2031	1.381.499	0,35
EUR	100.000	Erste Group Bank AG 0.13% 17/05/2028	91.310	0,02	EUR	3.250.000	AXA SA FRN 07/10/2041	2.921.148	0,74
EUR	2.000.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 1.50% 07/12/2026	2.028.745	0,51	GBP	2.900.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 26/10/2028	3.248.980	0,82
EUR	600.000	Telekom Finanzmanagement GmbH 3.50% 04/07/2023	624.755	0,16	EUR	2.600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 1.88% 18/06/2029	2.540.542	0,64
		<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>3.110.048</b>	<b>0,78</b>	EUR	2.200.000	BNP Paribas 1.00% 17/04/2024	2.211.619	0,56
					EUR	2.200.000	BNP Paribas SA FRN 14/10/2027	2.076.086	0,52
					EUR	3.600.000	BPCE SA 0.63% 26/09/2023	3.619.339	0,91
					EUR	2.900.000	BPCE SA FRN 02/02/2034	2.765.297	0,70
					EUR	2.400.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2026	2.310.880	0,58
					EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 15/09/2025	1.470.173	0,37
<b>BELGIEN</b>					EUR	1.500.000	Caisse des Depots et Consignations 0.01% 01/06/2026	1.455.724	0,37
EUR	400.000	Belfius Bank SA 0.38% 08/06/2027	375.519	0,09	EUR	2.000.000	Carrefour SA 2.63% 15/12/2027	2.075.605	0,52
EUR	700.000	Bpost SA 1.25% 11/07/2026	704.228	0,18	EUR	1.500.000	CNP Assurances FRN 27/07/2050	1.413.614	0,36
EUR	1.200.000	KBC Group NV FRN 16/06/2027	1.148.124	0,29	EUR	1.500.000	CNP Assurances Perp FRN	1.320.636	0,33
EUR	1.600.000	KBC Group NV 0.88% 27/06/2023	1.617.020	0,41	EUR	9.100.000	Credit Agricole SA 0.13% 09/12/2027	8.367.286	2,10
EUR	900.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027	837.636	0,21	EUR	1.200.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	1.102.728	0,28
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>4.682.527</b>	<b>1,18</b>	USD	500.000	Credit Agricole SA Perp FRN	474.936	0,12
					EUR	2.600.000	Credit Mutuel Arkea SA 0.38% 03/10/2028	2.404.050	0,61
<b>DÄNEMARK</b>					EUR	1.000.000	Credit Mutuel Arkea SA FRN 11/06/2029	969.150	0,24
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit A/S 0.75% 20/01/2027	1.145.426	0,29	EUR	4.300.000	Danone SA 1.00% 26/03/2025	4.318.818	1,09
EUR	600.000	Nykredit Realkredit A/S 0.88% 17/01/2024	600.228	0,15	EUR	700.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	634.812	0,16
EUR	550.000	Nykredit Realkredit AS 0.38% 17/01/2028	502.697	0,13	EUR	300.000	Electricite de France SA 1.00% 29/11/2033	272.062	0,07
EUR	1.200.000	Nykredit Realkredit AS FRN 28/07/2031	1.137.273	0,29	EUR	1.100.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	952.449	0,24
GBP	900.000	Orsted A/S 2.13% 17/05/2027	1.053.273	0,27	EUR	675.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	691.481	0,17
GBP	900.000	Orsted A/S 2.50% 16/05/2033	1.045.484	0,26	EUR	800.000	Ile-de-France Mobilites 0.40% 28/05/2031	751.730	0,19
EUR	1.300.000	Orsted AS FRN 09/12/3019	1.245.602	0,31	EUR	3.400.000	La Banque Postale SA 0.75% 23/06/2031	3.003.731	0,76
EUR	700.000	Orsted AS FRN 24/11/3017	705.957	0,18	EUR	700.000	La Banque Postale SA FRN 02/08/2032	629.807	0,16
		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>7.435.940</b>	<b>1,88</b>	EUR	400.000	La Banque Postale SA Perp FRN	387.092	0,10
					EUR	800.000	La Poste SA 1.38% 21/04/2032	784.266	0,20
<b>FINNLAND</b>					EUR	4.800.000	Orange SA 0.13% 16/09/2029	4.385.495	1,10
EUR	1.400.000	Elenia Finance Oyj 0.38% 06/02/2027	1.307.327	0,33	EUR	1.200.000	Orange SA Perp FRN	1.284.289	0,32
EUR	900.000	OP Corporate Bank plc 0.38% 26/02/2024	895.795	0,23					
EUR	500.000	OP Corporate Bank plc 0.60% 18/01/2027	478.180	0,12					
		<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>2.681.302</b>	<b>0,68</b>					
<b>FRANKREICH</b>									
EUR	3.000.000	Action Logement SE 0.50% 30/10/2034	2.690.263	0,68					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

## Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>					
EUR	700.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	706.130	0,18	GBP	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 1.88% 13/02/2026	1.764.076	0,44
EUR	800.000	Regie Autonome des Transports Parisiens 0.88% 25/05/2027	798.776	0,20	EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	2.316.325	0,58
EUR	1.100.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 0.75% 12/01/2034	999.140	0,25	EUR	1.700.000	Deutsche Bank AG FRN 23/02/2028	1.674.793	0,42
EUR	700.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 1.88% 23/10/2037	696.746	0,18	EUR	425.000	Deutsche Kreditbank AG 0.01% 07/11/2029	391.215	0,10
EUR	2.800.000	Sanofi 1.50% 01/04/2030	2.854.930	0,72	EUR	600.000	Deutsche Kreditbank AG 0.88% 02/10/2028	594.340	0,15
EUR	1.500.000	Schneider Electric SE 1.84% 13/10/2025	1.545.343	0,39	EUR	1.700.000	E.ON SE 0.35% 28/02/2030	1.557.774	0,39
EUR	300.000	SNCF Reseau 2.25% 20/12/2047	334.679	0,08	EUR	915.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	818.690	0,21
EUR	1.600.000	SNCF SA 0.63% 17/04/2030	1.538.176	0,39	EUR	1.985.000	E.ON SE 0.60% 01/10/2032	1.776.064	0,45
EUR	1.100.000	Societe du Grand Paris 1.63% 08/04/2042	1.114.144	0,28	EUR	300.000	E.ON SE 0.88% 08/01/2025	299.562	0,08
EUR	900.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	853.672	0,22	EUR	2.000.000	E.ON SE 1.63% 29/03/2031	2.002.920	0,49
EUR	2.500.000	Societe Generale SA FRN 02/12/2027	2.371.312	0,60	EUR	3.800.000	Eurogrid GmbH 1.11% 15/05/2032	3.558.945	0,89
EUR	1.500.000	Unedic Asseo 0.25% 25/11/2029	1.415.203	0,36	EUR	1.200.000	Eurogrid GmbH 1.63% 03/11/2023	1.220.326	0,31
EUR	950.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 1.00% 14/03/2025	942.566	0,24	EUR	300.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	270.697	0,07
EUR	1.000.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE Perp FRN	966.573	0,24	EUR	600.000	Hamburger Hochbahn AG 0.13% 24/02/2031	541.395	0,14
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>82.052.977</b>	<b>20,69</b>	EUR	1.000.000	Landesbank Baden- Wuerttemberg 0.38% 21/02/2031	879.197	0,22
					EUR	250.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	234.624	0,06
					EUR	750.000	Mercedes-Benz Group AG 0.75% 10/09/2030	703.873	0,18
					EUR	3.800.000	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG FRN 26/05/2041	3.397.776	0,85
<b>DEUTSCHLAND</b>					EUR	1.000.000	NRW Bank 0.10% 09/07/2035	851.518	0,21
EUR	1.100.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	1.063.257	0,27	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.930.734	0,49
EUR	1.000.000	Allianz SE FRN 08/07/2050	966.597	0,24	EUR	1.900.000	O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs GmbH 1.75% 05/07/2025	1.930.734	0,49
EUR	1.500.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.262.002	0,32	EUR	500.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	468.593	0,12
EUR	900.000	Bayerische Landesbode 0.25% 21/03/2036	780.705	0,20	EUR	300.000	Vantage Towers AG 0.38% 31/03/2027	281.156	0,07
EUR	1.100.000	Bayerische Landesbodenkreditanstalt 0.63% 22/11/2027	1.076.900	0,27	EUR	900.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	807.574	0,20
EUR	2.200.000	Commerzbank AG FRN 24/03/2026	2.153.675	0,54	EUR	100.000	Vantage Towers AG 0.75% 31/03/2030	89.730	0,02
EUR	200.000	Commerzbank AG 1.25% 23/10/2023	201.625	0,05	EUR	400.000	Vier Gas Transport GmbH 0.13% 10/09/2029	352.405	0,09
EUR	1.500.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.35% 29/09/2031	1.378.112	0,35					
EUR	600.000	Deutsche Bahn Finance GmbH 0.63% 08/12/2050	454.583	0,11					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.600.000	Vonovia SE 1.38% 28/01/2026	1.590.534	0,40	EUR	200.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	191.466	0,05
EUR	2.000.000	Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	1.986.428	0,51					
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>43.629.454</b>	<b>10,98</b>			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>14.400.781</b>	<b>3,64</b>
<b>IRLAND</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
EUR	900.000	AIB Group plc FRN 17/11/2027	840.858	0,21	EUR	2.750.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	2.729.727	0,69
EUR	1.500.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.482.260	0,37	EUR	400.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	353.089	0,09
EUR	1.000.000	Bank of Ireland Group FRN 10/05/2027	930.932	0,23	EUR	850.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	700.471	0,18
EUR	800.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	742.950	0,19	EUR	600.000	CPI Property Group SA 1.75% 14/01/2030	522.623	0,13
EUR	600.000	ESB Finance DAC 1.00% 19/07/2034	553.724	0,14	EUR	900.000	CPI Property Group SA 2.75% 12/05/2026	902.363	0,23
EUR	150.000	ESB Finance DAC 1.13% 11/06/2030	145.672	0,04	EUR	2.800.000	Holcim Finance Luxembourg SA 0.50% 23/04/2031	2.427.772	0,61
EUR	1.250.000	Kerry Group Financial Services 0.88% 01/12/2031	1.139.825	0,29	EUR	1.259.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.153.971	0,29
EUR	800.000	Lunar Funding V for Swisscom AG 1.13% 12/10/2026	797.530	0,20	EUR	141.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	129.237	0,03
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>6.633.751</b>	<b>1,67</b>	EUR	500.000	Prologis International Funding II SA 1.63% 17/06/2032	472.371	0,12
<b>ITALIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	641.903	0,16	EUR	1.300.000	ABN Amro Bank NV 0.88% 22/04/2025	1.305.915	0,33
EUR	700.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	641.903	0,16	EUR	1.100.000	Achmea BV 1.50% 26/05/2027	1.109.333	0,28
EUR	1.100.000	Assicurazioni Generali SpA 1.71% 30/06/2032	971.838	0,24	EUR	900.000	Allianz Finance II BV 0.00% 22/11/2026	861.317	0,22
EUR	2.425.000	Assicurazioni Generali SpA 2.12% 01/10/2030	2.328.014	0,59	EUR	2.100.000	Allianz Finance II BV 1.50% 15/01/2030	2.097.217	0,53
EUR	500.000	Banco BPM SpA 0.88% 15/07/2026	469.431	0,12	EUR	800.000	Cooperatieve Rabobank UA 0.25% 30/10/2026	768.387	0,19
EUR	1.100.000	ERG SpA 1.88% 11/04/2025	1.108.562	0,28	GBP	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA 4.63% 23/05/2029	1.284.621	0,32
EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato 1.50% 27/06/2025	1.218.915	0,31	EUR	600.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	543.602	0,14
EUR	1.200.000	Ferrovie dello Stato Italiane SpA 1.13% 09/07/2026	1.185.899	0,30	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	201.850	0,05
EUR	2.200.000	Intesa Sanpaolo SpA 0.75% 04/12/2024	2.188.076	0,55	EUR	1.000.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	1.009.252	0,25
EUR	1.600.000	Snam SpA 0.00% 07/12/2028	1.425.879	0,36					
EUR	200.000	Snam SpA 0.75% 17/06/2030	183.168	0,05					
EUR	1.600.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.38% 23/06/2029	1.462.795	0,37					
EUR	400.000	Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	382.932	0,10					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	200.000	De Volksbank NV 0.38% 03/03/2028	182.021	0,05	EUR	2.200.000	Swisscom Finance BV 0.38% 14/11/2028	2.082.727	0,52
EUR	3.700.000	De Volksbank NV FRN 22/10/2030	3.647.307	0,92	EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	520.407	0,13
EUR	2.300.000	Digital Dutch Finco BV 0.63% 15/07/2025	2.225.725	0,56	EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	86.735	0,02
EUR	1.450.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	1.337.107	0,34	EUR	800.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	753.027	0,19
EUR	1.870.000	Digital Intrepid Holding BV 0.63% 15/07/2031	1.555.006	0,39	EUR	500.000	Tennet Holding BV 0.50% 30/11/2040	385.933	0,10
EUR	1.000.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	1.004.379	0,25	EUR	1.393.000	TenneT Holding BV 0.88% 16/06/2035	1.231.450	0,31
EUR	300.000	EnBW International Finance BV 1.88% 31/10/2033	289.000	0,07	EUR	1.969.000	Tennet Holding BV Perp FRN	2.014.946	0,51
EUR	2.000.000	Enel Finance International NV 1.50% 21/07/2025	2.029.340	0,50	EUR	3.500.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.306.430	0,83
EUR	1.500.000	Enexis Holding NV 0.38% 14/04/2033	1.314.413	0,33	EUR	7.500.000	Volkswagen International Finance NV 0.88% 22/09/2028	7.032.133	1,76
EUR	1.029.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	936.724	0,24	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>54.915.248</b>	<b>13,81</b>
EUR	221.000	Enexis Holding NV 0.63% 17/06/2032	201.182	0,05	<b>NORWEGEN</b>				
EUR	1.000.000	GSK Consumer Healthcare Capital 1.75% 29/03/2030	1.009.261	0,25	EUR	200.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	184.298	0,05
EUR	1.100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.001.825	0,25	EUR	1.050.000	Avinor AS 0.75% 01/10/2030	967.566	0,24
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	504.754	0,13	EUR	1.850.000	Avinor AS 1.00% 29/04/2025	1.849.527	0,46
EUR	300.000	Iberdrola International BV Perp FRN	305.825	0,08	EUR	200.000	Avinor AS 1.25% 09/02/2027	198.751	0,05
EUR	500.000	Iberdrola International BV Perp FRN	516.570	0,13	EUR	840.000	Dnb Bank ASA FRN 18/01/2028	799.871	0,20
GBP	2.000.000	ING Groep NV FRN 07/12/2028	2.122.492	0,53	<b>Norwegen, insgesamt</b>			<b>4.000.013</b>	<b>1,00</b>
EUR	1.600.000	ING Groep NV 2.50% 15/11/2030	1.689.508	0,43	<b>SPANIEN</b>				
EUR	100.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	99.358	0,03	EUR	1.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 0.75% 04/06/2025	1.592.396	0,40
EUR	600.000	NE Property BV 3.38% 14/07/2027	596.145	0,15	EUR	1.000.000	Banco de Sabadell SA FRN 11/03/2027	973.203	0,25
EUR	100.000	NederFinMaat 0.13% 03/04/2027	95.977	0,02	EUR	1.300.000	Banco Santander SA 0.30% 04/10/2026	1.243.546	0,31
EUR	900.000	Royal Schiphol Group NV 1.50% 05/11/2030	894.632	0,23	EUR	1.100.000	Banco Santander SA 1.13% 23/06/2027	1.071.938	0,27
EUR	300.000	Royal Schiphol Group NV 2.00% 06/04/2029	310.987	0,08	EUR	4.200.000	Caixabank SA FRN 21/01/2028	3.992.068	1,01
EUR	1.000.000	Stedin Holding NV 0.00% 16/11/2026	942.351	0,24	EUR	300.000	Caixabank SA FRN 18/06/2031	283.171	0,07
EUR	3.400.000	Stedin Holding NV 0.50% 14/11/2029	3.157.060	0,79	EUR	1.000.000	CaixaBank SA FRN 26/05/2028	940.177	0,24
EUR	364.000	Stedin Holding NV Perp FRN	351.017	0,09	EUR	2.300.000	Iberdrola Finanzas SA 1.38% 11/03/2032	2.288.992	0,57
					EUR	300.000	Red Electrica Financiaciones Sau 0.38% 24/07/2028	287.210	0,07
					EUR	1.300.000	Telefonica Emisiones SA 1.07% 05/02/2024	1.315.895	0,33
					GBP	400.000	Telefonica Emisiones SA 5.45% 08/10/2029	550.090	0,14
					<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>14.538.686</b>	<b>3,66</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*				
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>							
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>							
<b>SCHWEDEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>							
EUR	1.500.000	Essity AB 1.13% 27/03/2024	1.512.485	0,38	EUR	200.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	181.724	0,05		
EUR	800.000	Svenska Handelsbanken AB 0.01% 02/12/2027	738.919	0,19	GBP	200.000	Nationwide Building Society Perp FRN	239.613	0,06		
EUR	100.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	100.399	0,03	GBP	500.000	Nationwide Building Society Perp FRN	602.628	0,15		
EUR	500.000	Volvo Car AB 2.50% 07/10/2027	501.995	0,13	EUR	5.000.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	4.612.954	1,15		
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>2.853.798</b>	<b>0,73</b>	GBP	354.000	Natwest Group plc FRN 09/11/2028	393.836	0,10		
<b>SCHWEIZ</b>				EUR				200.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	187.159	0,05
EUR	1.000.000	Credit Suisse AG 0.45% 19/05/2025	975.565	0,25	GBP	200.000	Orbit Capital plc 2.00% 24/11/2038	207.064	0,05		
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>975.565</b>	<b>0,25</b>	GBP	500.000	Paragon Treasury plc 2.00% 07/05/2036	532.041	0,13		
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				GBP				900.000	Pearson Funding plc 3.75% 04/06/2030	1.083.262	0,27
GBP	600.000	Aster Treasury plc 1.41% 27/01/2036	593.436	0,15	GBP	450.000	Platform HG Financing plc 1.93% 15/09/2041	459.582	0,12		
EUR	2.100.000	AstraZeneca plc 0.38% 03/06/2029	1.952.505	0,49	GBP	400.000	RCB Bonds plc 3.50% 08/12/2031	456.062	0,11		
GBP	100.000	Blend Funding plc 2.92% 05/04/2054	117.550	0,03	EUR	1.100.000	Rentokil Initial plc 0.50% 14/10/2028	996.195	0,25		
GBP	200.000	Blend Funding plc 3.46% 21/09/2049	256.049	0,06	GBP	1.000.000	RI Finance FRN 30/11/2043	1.242.610	0,31		
GBP	200.000	BUPA Finance plc 1.75% 14/06/2027	227.234	0,06	GBP	625.000	RI Finance Bonds No 4 plc FRN 07/10/2049	742.397	0,19		
GBP	800.000	BUPA Finance plc 5.00% 08/12/2026	1.015.493	0,25	GBP	500.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.00% 02/06/2040	505.588	0,13		
EUR	875.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	792.592	0,20	GBP	230.000	Severn Trent Utilities Finance plc 2.63% 22/02/2033	266.634	0,07		
EUR	125.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	113.227	0,03	GBP	1.100.000	Stonewater Funding plc 1.63% 10/09/2036	1.122.886	0,28		
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	88.817	0,02	EUR	1.790.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	1.701.420	0,43		
GBP	300.000	Cardiff University 3.00% 07/12/2055	379.303	0,09	GBP	500.000	Thames Water Utilities Finance plc 1.88% 24/01/2024	587.122	0,15		
GBP	630.000	Ds Smith plc 2.88% 26/07/2029	730.449	0,18	GBP	1.000.000	Thames Water Utilities Finance plc 2.38% 22/04/2040	1.035.180	0,26		
GBP	400.000	DWR Cymru Financing UK plc 2.38% 31/03/2034	435.599	0,11	GBP	240.000	United Utilities Wat 0.88% 28/10/2029	253.556	0,06		
GBP	100.000	Guinness Partnership Limited 2.00% 22/04/2055	99.010	0,02	GBP	200.000	University College London 1.63% 04/06/2061	191.348	0,05		
USD	1.500.000	HSBC Holdings plc FRN 22/11/2023	1.352.577	0,34	GBP	300.000	University of Southampton 2.25% 11/04/2057	320.017	0,08		
GBP	600.000	Legal & General Group plc FRN 27/10/2045	757.205	0,19	EUR	500.000	Vodafone Group plc 0.90% 24/11/2026	497.165	0,13		
EUR	3.800.000	Motability Operations Group plc 0.13% 20/07/2028	3.504.629	0,88	USD	1.000.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	927.742	0,23		
EUR	1.500.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.19% 20/01/2025	1.467.508	0,37							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>FRANKREICH</b>			
GBP	200.000 Wellcome Trust Limited 1.50% 14/07/2071	180.033	0,05	EUR	400.000 Agence France Locale 0.20% 20/03/2029	378.025	0,10
EUR	8.935.000 WellCome Trust Limited 1.13% 21/01/2027	9.018.765	2,27	EUR	1.000.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	947.061	0,24
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>42.427.766</b>	<b>10,65</b>	EUR	1.200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/11/2030	1.090.776	0,27
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				GBP	1.200.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.13% 15/12/2025	1.334.622	0,34
USD	225.000 Astrazeneca Finance LLC 2.25% 28/05/2031	188.573	0,05	USD	300.000 Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 2.13% 26/01/2032	256.697	0,06
EUR	1.000.000 Becton Dickinson and Company 1.40% 24/05/2023	1.012.030	0,25	EUR	300.000 Caisse Francaise de Financement Local 0.01% 07/05/2025	292.596	0,07
USD	1.100.000 Becton Dickinson and Company 2.82% 20/05/2030	941.705	0,24	EUR	1.100.000 Caisse Francaise de Financement Local 0.50% 19/02/2027	1.074.123	0,27
EUR	1.000.000 Digital Euro Finco LLC 2.50% 16/01/2026	1.024.019	0,26	EUR	2.100.000 City of Paris France 1.38% 20/11/2034	2.105.591	0,52
EUR	1.075.000 Prologis Euro Finance LLC 0.38% 06/02/2028	997.574	0,26	EUR	150.000 France (Govt of) OAT 1.75% 25/06/2039	164.103	0,04
USD	2.600.000 Roche Holdings Inc. 2.38% 28/01/2027	2.276.402	0,58	EUR	1.200.000 Region of Ile de France 0.00% 20/04/2028	1.136.292	0,29
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>6.440.303</b>	<b>1,64</b>	EUR	700.000 Region of Ile de France 0.50% 14/06/2025	698.964	0,18
<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>301.066.717</b>	<b>75,83</b>	EUR	400.000 Region of Ile de France 0.61% 02/07/2040	343.662	0,09
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				EUR	700.000 SNCF SA 1.00% 19/01/2061	502.631	0,13
<b>ÖSTERREICH</b>				EUR	600.000 Societe du Grand Paris EPIC 0.00% 25/11/2030	546.762	0,14
EUR	700.000 Oesterreichische Kontrollbank AG 0.00% 08/10/2026	669.050	0,17	EUR	100.000 Societe du Grand Paris EPIC 1.70% 25/05/2050	101.873	0,03
	<b>Österreich, insgesamt</b>	<b>669.050</b>	<b>0,17</b>	EUR	2.500.000 Unedic Asseo 0.00% 25/11/2028	2.352.922	0,59
<b>BELGIEN</b>				EUR	1.700.000 Unedic Asseo 0.00% 19/11/2030	1.549.168	0,39
EUR	275.000 Belgium (Govt of) 1.25% 22/04/2033	283.355	0,07	EUR	1.200.000 Unedic Asseo 0.10% 25/11/2026	1.159.037	0,29
EUR	1.500.000 Communaute Francaise de Belgique 0.63% 11/06/2035	1.352.072	0,34	<b>Frankreich, insgesamt</b>		<b>16.034.905</b>	<b>4,04</b>
EUR	1.400.000 Ministeries Van de Vlaamse Gemeenschap 0.38% 15/04/2030	1.336.872	0,34	<b>DEUTSCHLAND</b>			
EUR	1.800.000 Region Wallonne Belgium 1.05% 22/06/2040	1.627.870	0,41	EUR	1.650.000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2030	1.593.405	0,40
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>4.600.169</b>	<b>1,16</b>	EUR	725.000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.00% 15/08/2050	612.000	0,15
<b>FINNLAND</b>				EUR	100.000 Free and Hanseatic City of Hamburg 0.30% 16/09/2050	77.869	0,02
EUR	1.700.000 Kuntarahoitus Oyj 0.05% 10/09/2035	1.446.390	0,35	EUR	3.200.000 Landwirtschaftliche Rentenbank 0.00% 22/09/2027	3.059.968	0,77
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>1.446.390</b>	<b>0,35</b>	EUR	500.000 State of Hesse 0.01% 18/06/2031	454.494	0,11

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>						
EUR	1.475.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.60% 04/06/2041	1.290.611	0,33	EUR	650.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 1.50% 15/06/2039	669.057	0,17	
EUR	600.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 0.95% 13/03/2028	601.294	0,15	EUR	235.000	Netherlands (Govt of) 0.50% 15/01/2040	221.920	0,06	
<b>Deutschland, insgesamt</b>				<b>1,93</b>	<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>2.395.679</b>	<b>0,61</b>
<b>UNGARN</b>					<b>POLEN</b>					
EUR	250.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1.38% 24/06/2025	249.265	0,06	EUR	500.000	Poland (Govt of) 1.13% 07/08/2026	499.769	0,13	
<b>Ungarn, insgesamt</b>				<b>0,06</b>	<b>Polen, insgesamt</b>				<b>499.769</b>	<b>0,13</b>
<b>IRLAND</b>					<b>SPANIEN</b>					
EUR	25.000	Ireland (Govt of) 1.35% 18/03/2031	26.111	0,01	EUR	1.500.000	Autonomous Community of Andalusia 0.50% 30/04/2031	1.374.804	0,35	
GBP	325.000	NIE Finance plc 6.38% 02/06/2026	444.890	0,11	EUR	1.400.000	Autonomous Community of Madrid 0.42% 30/04/2030	1.310.491	0,33	
<b>Irland, insgesamt</b>				<b>0,12</b>	EUR	700.000	Autonomous Community of Madrid 1.57% 30/04/2029	720.219	0,18	
<b>ITALIEN</b>					EUR	200.000	Basque (Govt) 0.25% 30/04/2031	181.894	0,05	
EUR	1.900.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 0.75% 21/11/2022	1.913.372	0,48	EUR	3.200.000	Community of Madrid 1.72% 30/04/2032	3.265.794	0,82	
EUR	800.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.00% 11/02/2030	750.876	0,19	EUR	1.500.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	1.478.445	0,37	
EUR	1.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 1.50% 20/04/2023	1.221.258	0,31	EUR	200.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2025	197.126	0,05	
EUR	700.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.00% 20/04/2027	723.233	0,18	EUR	700.000	Instituto de Credito Oficial 0.25% 30/04/2024	700.415	0,18	
EUR	2.200.000	Cassa Depositi e Prestiti SpA 2.13% 21/03/2026	2.287.083	0,58	EUR	3.100.000	Instituto de Credito Oficial 0.75% 31/10/2023	3.130.521	0,79	
EUR	315.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	268.677	0,07	EUR	25.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	21.655	0,01	
<b>Italien, insgesamt</b>				<b>1,81</b>	EUR	400.000	Xunta de Galicia 0.08% 30/07/2027	380.326	0,10	
<b>LUXEMBURG</b>					<b>Spanien, insgesamt</b>				<b>12.761.690</b>	<b>3,23</b>
EUR	775.000	Luxembourg (Govt of) 0.00% 14/09/2032	691.846	0,17	<b>SUPRANATIONAL</b>					
<b>Luxemburg, insgesamt</b>				<b>0,17</b>	EUR	2.200.000	African Development Bank 0.25% 21/11/2024	2.179.365	0,55	
<b>NIEDERLANDE</b>					USD	350.000	African Development Bank 0.75% 03/04/2023	310.851	0,08	
EUR	1.000.000	Bank Nederlandse Gemeenten NV 0.05% 13/07/2024	989.577	0,25	CAD	300.000	Asian Development Bank 1.50% 04/05/2028	200.206	0,05	
EUR	600.000	Nederlandse Waterschapsbank NV 0.13% 03/09/2035	515.125	0,13	CAD	800.000	Asian Development Bank 1.63% 28/01/2025	559.238	0,14	
					EUR	1.450.000	Council of Europe 0.38% 27/03/2025	1.438.851	0,36	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>SUPRANATIONAL (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>						
EUR	1.800.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 10/04/2026	1.746.872	0,44	USD	1.800.000	International Finance Facility for Immunisation Company 1.00% 21/04/2026	1.516.178	0,38	
EUR	4.000.000	Council of Europe Development Bank 0.00% 09/04/2027	3.835.845	0,96	GBP	5.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	5.421	0,00	
EUR	300.000	Eurofima 0.50% 23/04/2041	252.279	0,06	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>					
EUR	3.000.000	European Investment Bank 0.00% 15/05/2028	2.850.743	0,72	<b>5.335.405 1,34</b>					
GBP	975.000	European Investment Bank 0.88% 15/05/2026	1.113.435	0,28	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					
EUR	3.750.000	European Union 0.00% 02/06/2028	3.563.455	0,90	<b>84.430.037 21,27</b>					
EUR	250.000	European Union 0.00% 04/07/2035	213.280	0,05	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					
EUR	700.000	European Union 0.00% 04/07/2035	597.183	0,15	<b>385.496.754 97,10</b>					
EUR	1.650.000	European Union 0.10% 04/10/2040	1.330.400	0,34	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
EUR	2.800.000	European Union 0.30% 04/11/2050	2.142.673	0,54	<b>Anleihen</b>					
EUR	399.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	272.678	0,07	<b>FRANKREICH</b>					
GBP	250.000	Inter-American Development Bank 0.50% 15/09/2026	279.619	0,07	USD	700.000	Credit Agricole 2.81% 11/01/2041	520.654	0,13	
EUR	500.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.01% 24/04/2028	472.060	0,12	USD	1.055.000	Credit Agricole SA Perp FRN	861.598	0,22	
EUR	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	87.826	0,02	<b>Frankreich, insgesamt</b>					
EUR	300.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.70% 22/10/2046	263.477	0,07	<b>1.382.252 0,35</b>					
USD	210.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.13% 13/09/2028	172.850	0,04	<b>NIEDERLANDE</b>					
SEK	3.000.000	Nordic Investment Bank 0.10% 13/10/2025	273.257	0,07	USD	550.000	Cooperatieve Rabobank UA 1.00% 24/09/2026	455.449	0,11	
<b>Supranational, insgesamt</b>				<b>24.156.443</b>	<b>6,08</b>	<b>Niederlande, insgesamt</b>				
						<b>455.449 0,11</b>				
						<b>Anleihen, insgesamt</b>				
						<b>1.837.701 0,46</b>				
<b>SCHWEDEN</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>						
SEK	3.000.000	Sweden (Govt of) 0.13% 09/09/2030	264.285	0,07	<b>1.837.701 0,46</b>					
<b>Schweden, insgesamt</b>				<b>264.285</b>	<b>0,07</b>	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				
						<b>Anleihen</b>				
						<b>FRANKREICH</b>				
						USD	1.000.000	BPCE SA FRN 14/01/2037	841.058	0,21
						<b>Frankreich, insgesamt</b>				
						<b>841.058 0,21</b>				
						<b>Anleihen, insgesamt</b>				
						<b>841.058 0,21</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>						
USD	4.375.000	International Finance Facility for Immunisation Company 0.38% 06/11/2023	3.813.806	0,96	<b>841.058 0,21</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Social Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
42.799	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	4.204.024	1,06
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>4.204.024</b>	<b>1,06</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>4.204.024</b>	<b>1,06</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>4.204.024</b>	<b>1,06</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>392.379.537</b>	<b>98,83</b>

(Gesamtkosten: EUR 417.737.065)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				
EUR	823.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033		EUR	431.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027		
			723.651				0,39	
EUR	935.000	APT Pipelines Limited 2.00% 15/07/2030		EUR	484.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026		
			915.030			442.405	0,24	
EUR	418.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031		EUR	480.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029		
			368.420			447.504	0,24	
GBP	840.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023		EUR	1.112.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029		
			1.025.325			1.024.307	0,54	
		<b>Australien, insgesamt</b>	<b>3.032.426</b>		EUR	800.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	
			<b>1,63</b>			735.152	0,39	
<b>BELGIEN</b>				EUR	1.600.000	Credit Agricole SA 1.13% 24/02/2029		
EUR	619.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040				1.567.472	0,84	
			746.294	EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN		
			394.692			538.985	0,29	
EUR	400.000	Kbc Group NV Perp FRN		EUR	600.000	Electricite de France SA Perp FRN		
			744.566			540.769	0,29	
EUR	800.000	Vgp NV 1.63% 17/01/2027		EUR	431.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026		
			<b>1.885.552</b>			394.197	0,21	
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>1,01</b>	EUR	552.000	Emeria SASU 3.38% 31/03/2028		
						520.894	0,28	
<b>KANADA</b>				EUR	357.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2027		
EUR	299.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028				319.466	0,17	
			279.231	EUR	687.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027		
			<b>279.231</b>			629.586	0,34	
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>0,15</b>	EUR	677.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025		
						693.530	0,37	
<b>KAIMANINSELN</b>				EUR	300.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031		
USD	1.089.000	Alibaba Group Holding Limited 4.00% 06/12/2037				283.882	0,15	
			914.686	EUR	1.061.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026		
			706.242			1.075.718	0,59	
USD	800.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027		EUR	200.000	Iliad SA 0.75% 11/02/2024		
			3.742.123			193.843	0,10	
GBP	3.235.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028		EUR	200.000	Iliad SA 1.50% 14/10/2024		
			375.677			194.940	0,10	
USD	534.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050		EUR	377.000	Iqera Group SAS 4.25% 30/09/2024		
			452.428			372.834	0,20	
EUR	460.000	UPCB Finance VII 3.63% 15/06/2029		EUR	202.000	Laboratoire Eimer Selas 5.00% 01/02/2029		
			<b>6.191.156</b>			188.836	0,10	
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>3,31</b>	EUR	270.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025		
						272.365	0,15	
<b>FRANKREICH</b>				EUR	383.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026		
EUR	152.000	Altice France SA 3.38% 15/01/2028				372.833	0,20	
			138.218	EUR	314.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028		
			154.313			297.322	0,16	
EUR	171.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029		EUR	1.700.000	Sanef SA 1.88% 16/03/2026		
			643.249			1.708.332	0,92	
EUR	707.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029		EUR	200.000	Valeo 1.00% 03/08/2028		
			925.865			174.936	0,09	
EUR	1.000.000	BNP Paribas SA FRN 11/07/2030		EUR	500.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028		
			866.906			467.244	0,25	
EUR	1.000.000	BPCE SA FRN 13/10/2046		EUR	600.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031		
						530.519	0,28	
						<b>17.085.086</b>	<b>9,14</b>	
				<b>FRANKREICH, insgesamt</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				EUR	800.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023		
						760.626	0,41	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>			
EUR	700.000 Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	657.719	0,36	EUR	700.000 Vonovia SE 1.88% 28/06/2028	695.250	0,37
EUR	1.400.000 Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	1.177.869	0,63		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>15.987.410</b>	<b>8,59</b>
EUR	1.200.000 Bayer AG 1.13% 06/01/2030	1.124.927	0,61				
EUR	477.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	463.917	0,25	<b>INDIEN</b>			
EUR	131.000 Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	129.700	0,07	USD	1.328.000 Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	1.151.050	0,62
EUR	1.000.000 Commerzbank AG FRN 05/12/2030	1.024.833	0,55	USD	2.100.000 GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	1.730.870	0,93
EUR	500.000 Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	468.020	0,25		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>2.881.920</b>	<b>1,55</b>
EUR	200.000 Deutsche Bank AG Perp FRN	204.764	0,11				
EUR	200.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	196.913	0,11	<b>IRLAND</b>			
EUR	800.000 Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	745.561	0,39	EUR	1.000.000 AIB Group plc FRN 19/11/2029	978.029	0,52
EUR	300.000 Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	289.517	0,16	EUR	450.000 AIB Group plc FRN 30/05/2031	444.678	0,24
EUR	300.000 Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	289.445	0,16	EUR	378.000 AIB Group plc Perp FRN	392.135	0,21
EUR	500.000 Eurogrid GmbH 0.74% 21/04/2033	437.100	0,23	EUR	720.000 Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	668.655	0,36
EUR	100.000 Gruenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	99.368	0,05	EUR	969.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	957.009	0,51
EUR	247.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	240.829	0,13	GBP	135.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	151.126	0,08
EUR	648.000 Gruenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	631.811	0,34		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.591.632</b>	<b>1,92</b>
EUR	1.100.000 Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	1.064.311	0,57	<b>ITALIEN</b>			
EUR	800.000 Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	683.017	0,37	EUR	880.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 26/09/2029	832.065	0,44
EUR	933.000 Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	889.978	0,48	EUR	201.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	195.684	0,10
EUR	1.070.000 PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	1.031.760	0,56	EUR	565.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	531.216	0,28
EUR	705.000 Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	699.088	0,37	EUR	385.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	350.517	0,19
EUR	800.000 Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	804.764	0,44	EUR	371.000 Eni SpA Perp FRN	355.275	0,19
EUR	310.000 Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	305.865	0,16	EUR	387.000 Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	368.639	0,20
EUR	100.000 Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	98.132	0,05	EUR	586.000 IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	550.466	0,30
EUR	216.000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	208.162	0,11	EUR	287.000 International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	289.964	0,16
EUR	316.511 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 6.00% 30/07/2026	317.609	0,17	EUR	304.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	290.210	0,16
EUR	300.000 Vonovia SE 1.50% 14/06/2041	246.555	0,13	EUR	700.000 Terna - Rete Elettrica Nazionale Perp FRN	670.131	0,36
					<b>Italien, insgesamt</b>	<b>4.434.167</b>	<b>2,38</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>JERSEY - KANALINSELN</b>				<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					
EUR	155.000	Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	156.098	0,08	EUR	1.086.000	Medtronic Global Holdings SCA 1.38% 15/10/2040	968.717	0,51
USD	1.683.497	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	1.398.239	0,75	USD	1.143.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	1.089.905	0,58
USD	776.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	628.066	0,34	EUR	1.406.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	1.288.708	0,69
EUR	631.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	573.489	0,31	EUR	185.000	Picard Bondco SA 5.38% 01/07/2027	175.738	0,09
EUR	245.000	Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	239.969	0,13	EUR	467.000	Sani/lkos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	459.041	0,25
		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>2.995.861</b>	<b>1,61</b>			<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>14.284.547</b>	<b>7,67</b>
<b>LUXEMBURG</b>				<b>MEXIKO</b>					
EUR	400.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	353.547	0,19	EUR	836.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	798.809	0,43
EUR	568.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	502.162	0,27	EUR	214.000	Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	198.784	0,11
EUR	225.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	201.454	0,11			<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>997.593</b>	<b>0,54</b>
EUR	128.000	Altice France Holding SA 4.00% 15/02/2028	110.268	0,06	<b>NIEDERLANDE</b>				
EUR	1.220.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	1.261.648	0,67	EUR	611.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	565.265	0,30
EUR	2.200.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	2.009.394	1,09	EUR	525.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	529.595	0,28
GBP	300.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	341.357	0,18	EUR	209.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	216.308	0,12
GBP	383.000	B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	444.504	0,24	EUR	545.000	Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	479.436	0,26
EUR	298.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	263.051	0,14	GBP	1.508.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	2.223.154	1,19
EUR	670.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	552.136	0,30	EUR	700.000	EDP Finance BV 1.88% 21/09/2029	703.065	0,38
EUR	662.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	610.980	0,34	EUR	700.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	649.748	0,35
EUR	366.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	347.322	0,19	EUR	800.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	786.716	0,42
EUR	577.436	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	581.143	0,31	EUR	450.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	466.824	0,25
EUR	311.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	305.217	0,16	USD	667.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	538.773	0,29
EUR	338.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	337.339	0,18	EUR	416.000	Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	371.578	0,19
GBP	496.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	584.293	0,31	EUR	410.400	Oci NV 3.63% 15/10/2025	417.550	0,22
EUR	1.430.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	1.316.340	0,71	EUR	449.000	PPF Telecom Group BV 3.50% 20/05/2024	456.135	0,24
EUR	180.000	Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	180.283	0,10	EUR	171.000	Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	178.247	0,10
					EUR	750.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	659.081	0,35

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>SCHWEDEN (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.258.000	Stedin Holding NV Perp FRN	1.213.130	0,65	EUR	755.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	698.887	0,38
EUR	610.000	Stichting Ak Rabobank Perp 6.50%	713.110	0,38	<b>Schweden, insgesamt</b>		<b>2.955.378</b>	<b>1,59</b>	
EUR	451.797	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	451.051	0,24	<b>SCHWEIZ</b>				
EUR	600.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	555.651	0,30	EUR	857.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	771.387	0,41
EUR	1.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	1.763.821	0,96	EUR	1.515.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	1.231.501	0,66
EUR	300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	319.062	0,17	EUR	851.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	775.367	0,42
EUR	1.547.000	Tennet Holding BV Perp FRN	1.553.230	0,83	USD	481.000	UBS Group AG Perp FRN	435.552	0,23
EUR	805.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	725.396	0,39	USD	275.000	UBS Group AG Perp FRN	262.795	0,14
EUR	1.000.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	944.694	0,51	<b>Schweiz, insgesamt</b>		<b>3.476.602</b>	<b>1,86</b>	
EUR	101.000	United Group BV 3.13% 15/02/2026	94.593	0,05	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
EUR	269.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	252.113	0,14	EUR	300.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	287.850	0,15
EUR	500.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	599.524	0,32	GBP	710.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	685.268	0,37
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>18.426.850</b>	<b>9,88</b>	EUR	1.113.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	1.117.968	0,60
<b>PANAMA</b>					EUR	1.156.000	British American Tobacco plc Perp FRN	1.055.138	0,56
EUR	265.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	271.850	0,15	EUR	1.375.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	1.245.501	0,67
<b>Panama, insgesamt</b>			<b>271.850</b>	<b>0,15</b>	GBP	359.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	389.455	0,21
<b>SPANIEN</b>					GBP	548.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	648.474	0,35
EUR	400.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	341.577	0,18	GBP	790.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	894.992	0,48
EUR	838.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	798.911	0,43	EUR	632.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	622.522	0,33
EUR	661.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	638.647	0,34	USD	875.446	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	774.734	0,42
EUR	700.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	617.215	0,33	EUR	1.074.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	1.138.959	0,61
EUR	298.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	297.131	0,16	GBP	482.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	672.936	0,36
<b>Spanien, insgesamt</b>			<b>2.693.481</b>	<b>1,44</b>	USD	570.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	501.378	0,27
<b>SCHWEDEN</b>					EUR	602.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	591.930	0,32
EUR	660.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	601.704	0,32	EUR	130.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	123.163	0,07
EUR	1.087.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.020.286	0,55	EUR	362.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	342.960	0,18
EUR	674.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	634.501	0,34	GBP	514.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	615.850	0,33

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	301.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	281.536	0,15	EUR	643.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	594.486	0,32
EUR	450.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	454.229	0,24	GBP	272.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	295.189	0,16
GBP	315.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	371.715	0,20	EUR	432.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	441.997	0,24
EUR	286.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	259.407	0,14	USD	650.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	603.033	0,32
EUR	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	514.757	0,28	GBP	1.248.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	1.359.824	0,73
GBP	445.000	Legal & General Group plc FRN 14/11/2048	562.372	0,30	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>29.973.152</b>	<b>16,07</b>
GBP	560.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	747.833	0,40	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
GBP	175.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	203.259	0,11	USD	424.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	400.117	0,21
GBP	403.738	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	502.923	0,27	USD	300.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	307.521	0,16
EUR	600.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	545.173	0,29	USD	209.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	195.006	0,10
EUR	602.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	552.871	0,30	EUR	660.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	609.926	0,33
GBP	239.000	Natwest Group plc Perp FRN	280.005	0,15	EUR	190.000	Ardagh Metal Packaging 3.00% 01/09/2029	169.892	0,09
EUR	2.337.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	2.186.952	1,17	EUR	540.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	492.944	0,26
EUR	375.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	377.417	0,20	EUR	2.213.000	Bank of America Corp. FRN 22/03/2031	2.020.157	1,08
GBP	397.000	Pinnacle Bidco plc 6.38% 15/02/2025	470.420	0,25	EUR	521.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	484.554	0,26
GBP	747.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	871.831	0,47	EUR	300.000	Bank of America Corp. FRN 31/03/2029	332.108	0,18
GBP	165.000	Santander UK plc Perp 10.06%	343.388	0,18	EUR	1.219.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	1.214.948	0,65
EUR	481.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	459.976	0,25	USD	243.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	254.034	0,14
GBP	390.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	439.273	0,24	EUR	706.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	662.670	0,36
GBP	387.671	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	541.254	0,29	EUR	480.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	374.588	0,20
GBP	620.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	708.763	0,38	EUR	367.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	350.060	0,19
EUR	1.405.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	1.335.473	0,72	EUR	320.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	318.138	0,17
GBP	659.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	774.661	0,41	EUR	228.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	226.673	0,12
EUR	489.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	471.461	0,25	GBP	319.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	366.360	0,20
GBP	221.000	Virgin Media Secured Finance plc 4.25% 15/01/2030	240.529	0,13	EUR	462.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	469.725	0,25
GBP	400.000	Virgin Money UK plc FRN 24/04/2026	472.067	0,25	EUR	804.000	General Motors Financial Company Inc. 0.60% 20/05/2027	736.840	0,39

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	176.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	158.320	0,08	USD	404.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	332.363	0,18
EUR	700.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	666.365	0,36	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>				
EUR	395.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	363.053	0,19	<b>25.623.506</b>	<b>13,72</b>			
EUR	478.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	462.262	0,25	<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				
USD	1.060.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	869.187	0,47	USD	893.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	871.242	0,47
USD	1.627.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	1.340.827	0,72	<b>Britische Jungfernseln, insgesamt</b>				
EUR	351.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	359.165	0,19	<b>871.242</b>	<b>0,47</b>			
GBP	1.960.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	2.435.912	1,31	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
USD	1.064.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	967.131	0,52	<b>157.938.642</b>	<b>84,68</b>			
EUR	1.728.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.832.914	0,99	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
EUR	1.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	1.089.189	0,58	<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				
USD	180.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	159.422	0,09	USD	333.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	257.167	0,14
USD	250.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	238.929	0,13	<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>				
USD	220.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	227.138	0,12	<b>257.167</b>	<b>0,14</b>			
USD	230.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	232.238	0,12	<b>ÄGYPTEN</b>				
USD	145.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	154.734	0,08	EUR	450.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	380.108	0,20
USD	265.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	306.926	0,16	<b>Ägypten, insgesamt</b>				
EUR	706.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	650.256	0,35	<b>380.108</b>	<b>0,20</b>			
EUR	202.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	177.432	0,10	<b>ITALIEN</b>				
EUR	655.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	621.350	0,33	EUR	926.000	Italy (Govt of) BPT 2.45% 01/09/2050	923.648	0,50
EUR	454.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	467.053	0,25	<b>Italien, insgesamt</b>				
EUR	214.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	195.319	0,10	<b>923.648</b>	<b>0,50</b>			
EUR	530.000	Southern Company FRN 15/09/2081	473.155	0,25	<b>ELFENBEINKÜSTE</b>				
EUR	190.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	189.397	0,10	EUR	250.000	Ivory Coast (Govt of) 5.25% 22/03/2030	231.602	0,12
EUR	218.000	Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	197.260	0,11	EUR	290.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	269.252	0,14
GBP	350.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	469.948	0,25	<b>Elfenbeinküste, insgesamt</b>				
					<b>500.854</b>	<b>0,26</b>			
					<b>SENEGAL</b>				
					EUR	390.000	Senegal (Govt of) 4.75% 13/03/2028	379.962	0,20
					<b>Senegal, insgesamt</b>				
					<b>379.962</b>	<b>0,20</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>ITALIEN</b>			
GBP	6.800.000 United Kingdom Gilt 0.38% 22/10/2026	7.663.486	4,12	USD	400.000 Intesa Sanpaolo SpA 4.00% 23/09/2029	348.927	0,19
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>7.663.486</b>	<b>4,12</b>		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>348.927</b>	<b>0,19</b>
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
		<b>10.105.225</b>	<b>5,42</b>	USD	467.000 Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	430.700	0,23
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>Niederlande, insgesamt</b>			
		<b>168.043.867</b>	<b>90,10</b>			<b>430.700</b>	<b>0,23</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
USD	1.270.000 Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	1.179.182	0,62	USD	1.229.000 Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	1.110.519	0,60
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>1.179.182</b>	<b>0,62</b>	USD	1.196.000 Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	1.102.626	0,59
<b>BERMUDAS</b>				USD	250.000 Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	241.821	0,13
USD	833.000 Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	765.631	0,41	USD	164.000 Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	184.245	0,10
	<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>765.631</b>	<b>0,41</b>		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>2.639.211</b>	<b>1,42</b>
<b>KANADA</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
USD	507.000 Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	452.266	0,24	<b>Anleihen</b>			
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>452.266</b>	<b>0,24</b>	<b>PORTUGAL</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				EUR	100.000 Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	11.000	0,01
USD	1.819.000 Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.489.185	0,80		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>11.000</b>	<b>0,01</b>
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>1.489.185</b>	<b>0,80</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
<b>FRANKREICH</b>				EUR	451.000 BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30.11.2029	411.446	0,22
USD	850.000 BPCE SA 2.70% 01/10/2029	726.583	0,39	GBP	812.000 Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	930.910	0,50
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>726.583</b>	<b>0,39</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
GBP	375.000 Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	421.629	0,23
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>1.763.985</b>	<b>0,95</b>
	<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>1.774.985</b>	<b>0,96</b>
	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>1.774.985</b>	<b>0,96</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

#### Fonds

#### IRLAND

81	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	7.986	0,00
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>7.986</b>	<b>0,00</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>7.986</b>	<b>0,00</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>7.986</b>	<b>0,00</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>177.858.523</b>	<b>95,36</b>
	<b>(Gesamtkosten: EUR 186.378.157)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>KAIMANINSELN (Fortsetzung)</b>					
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	201.675	0,50	USD	200.000	Tencent Holdings Limited 3.60% 19/01/2028	195.820	0,48
USD	400.000	Geopark Limited 5.50% 17/01/2027	379.500	0,93	USD	367.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	342.759	0,84
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	187.585	0,46	USD	200.000	Vale Overseas Limited 3.75% 08/07/2030	193.055	0,47
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>768.760</b>	<b>1,89</b>	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>4.547.036</b>	<b>11,11</b>
<b>BRASILIEN</b>				<b>KOLUMBIEN</b>					
USD	500.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	466.874	1,13	USD	650.000	Ecopetrol SA 6.88% 29/04/2030	684.814	1,67
<b>Brasilien, insgesamt</b>			<b>466.874</b>	<b>1,13</b>	<b>Kolumbien, insgesamt</b>			<b>684.814</b>	<b>1,67</b>
<b>KANADA</b>				<b>GUATEMALA</b>					
USD	716.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	740.223	1,80	USD	460.000	CT Trust 5.13% 03/02/2032	460.115	1,12
<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>740.223</b>	<b>1,80</b>	<b>Guatemala, insgesamt</b>			<b>460.115</b>	<b>1,12</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>HONGKONG</b>					
USD	200.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	189.749	0,46	USD	800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	838.925	2,05
USD	200.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	169.557	0,41	USD	330.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	285.949	0,70
USD	200.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	199.759	0,49	<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>1.124.874</b>	<b>2,75</b>
USD	600.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	589.350	1,44	<b>INDIEN</b>				
USD	212.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	190.402	0,46	USD	200.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	182.249	0,44
USD	400.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	382.581	0,93	USD	220.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	216.362	0,53
USD	200.000	Longfor Group Holdings Limited 3.95% 16/09/2029	179.260	0,44	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	390.321	0,95
USD	400.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	323.326	0,79	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.20% 04/08/2027	197.349	0,48
USD	400.000	Melco Resorts Finance Limited 5.75% 21/07/2028	353.085	0,86	USD	200.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	202.821	0,49
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	195.080	0,48	USD	200.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	189.716	0,46
USD	200.000	QNB Finance Limited 2.75% 12/02/2027	195.080	0,48	USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.064	0,50
USD	300.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	285.332	0,70	USD	250.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	249.405	0,61
USD	400.000	Saudi Electricity Company 2.41% 17/09/2030	379.283	0,93	USD	475.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	435.985	1,06
USD	200.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	183.558	0,45	<b>Indien, insgesamt</b>			<b>2.269.272</b>	<b>5,52</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>INDONESIEN</b>				<b>MAURITIUS</b>					
USD	295.000	Bank Mandiri Persero Tbk PT 4.75% 13/05/2025	306.189	0,75	USD	289.110	Azure Power Energy Limited 3.58% 19/08/2026	275.865	0,67
USD	400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	446.555	1,09	USD	200.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	201.770	0,49
USD	208.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	204.727	0,50	USD	400.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	395.500	0,96
USD	600.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	73.003	0,18	USD	300.000	Network I2i Limited Perp FRN	299.400	0,73
		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.030.474</b>	<b>2,52</b>			<b>Mauritius, insgesamt</b>	<b>1.172.535</b>	<b>2,85</b>
<b>IRLAND</b>				<b>MEXIKO</b>					
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	59.670	0,15	USD	400.000	America Movil SAB de CV 5.38% 04/04/2032	399.652	0,97
USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	118.300	0,29	USD	500.000	BBVA Bancomer SA FRN 13/09/2034	491.700	1,20
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>177.970</b>	<b>0,44</b>	USD	400.000	Braskem Idesa SAPI 6.99% 20/02/2032	392.750	0,96
<b>INSEL MAN</b>				<b>MAROKKO</b>					
USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	187.108	0,46	USD	400.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	398.248	0,97
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	379.352	0,92	USD	400.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	428.150	1,05
		<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>566.460</b>	<b>1,38</b>	USD	237.000	Gruma SAB de CV 4.88% 01/12/2024	247.102	0,60
<b>JERSEY - KANALINSELN</b>				<b>MEXIKO, insgesamt</b>					
USD	200.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	180.108	0,44			<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>3.219.818</b>	<b>7,84</b>
USD	272.183	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	247.205	0,60	<b>MAROKKO</b>				
USD	440.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 3.25% 30/09/2040	399.651	0,97	USD	240.000	OCP SA 3.75% 23/06/2031	218.746	0,53
		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>826.964</b>	<b>2,01</b>	USD	557.000	OCP SA 6.88% 25/04/2044	570.283	1,39
<b>LUXEMBURG</b>				<b>MAROKKO, insgesamt</b>					
USD	550.000	Hidrovias Int Finance Sar 4.95% 08/02/2031	464.406	1,13			<b>Marokko, insgesamt</b>	<b>789.029</b>	<b>1,92</b>
USD	250.000	Mhp Lux SA 0.00% 03/04/2026	121.500	0,30	<b>NIEDERLANDE</b>				
USD	500.000	MHP SE 0.00% 10/05/2024	238.870	0,58	USD	368.600	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	351.306	0,86
USD	544.500	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	577.695	1,41	USD	230.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	102.748	0,25
USD	400.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	400.799	0,98	USD	500.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	449.375	1,10
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>1.803.270</b>	<b>4,40</b>	USD	400.000	Petrobras Global Finance BV 6.75% 03/06/2050	392.250	0,96
					USD	500.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	515.738	1,26
					USD	392.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 3.15% 01/10/2026	356.113	0,86

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>SAUDI ARABIA (Fortsetzung)</b>						
USD	250.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV 4.75% 09/05/2027	240.456	0,59	USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	201.850	0,49	
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>2.407.986</b>	<b>5,88</b>	<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>			<b>1.154.925</b>	<b>2,81</b>	
<b>PERU</b>				<b>SINGAPUR</b>						
USD	500.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	487.548	1,19	USD	200.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	180.497	0,44	
USD	431.100	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	431.822	1,05	USD	600.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	612.484	1,49	
USD	200.000	Volcan Compania Minera SA 4.38% 11/02/2026	192.000	0,47	USD	200.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 2.38% 28/08/2029	191.082	0,47	
<b>Peru, insgesamt</b>			<b>1.111.370</b>	<b>2,71</b>	USD	450.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	418.415	1,02	
<b>PHILIPPINEN</b>			<b>SÜDAFRIKA</b>			<b>Singapur, insgesamt</b>			<b>1.402.478</b>	<b>3,42</b>
USD	250.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	217.863	0,53	USD	200.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	197.617	0,48	
USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	200.595	0,49	USD	250.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	242.688	0,59	
USD	357.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	341.714	0,83	USD	244.000	Transnet SOC Limited 4.00% 26/07/2022	240.267	0,59	
USD	200.000	Pldt Inc. 2.50% 23/01/2031	183.010	0,45	<b>Südafrika, insgesamt</b>			<b>680.572</b>	<b>1,66</b>	
USD	430.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	396.191	0,97	<b>THAILAND</b>					
<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>1.339.373</b>	<b>3,27</b>	USD	700.000	Bangkok Bank plc FRN 25/09/2034	654.941	1,60	
<b>KATAR</b>				<b>TÜRKEI</b>						
USD	410.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	378.758	0,92	USD	200.000	GC Treasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	183.324	0,45	
<b>Katar, insgesamt</b>			<b>378.758</b>	<b>0,92</b>	USD	200.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	188.615	0,46	
<b>SÜDKOREA</b>				<b>THAILAND, insgesamt</b>				<b>1.026.880</b>	<b>2,51</b>	
USD	200.000	Kookmin Bank 4.50% 01/02/2029	208.819	0,51	USD	200.000	Akbank TAS 6.80% 06/02/2026	195.214	0,48	
USD	380.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	352.326	0,86	USD	380.000	KOC Holding AS 6.50% 11/03/2025	382.542	0,93	
<b>Südkorea, insgesamt</b>			<b>561.145</b>	<b>1,37</b>	USD	250.000	Türk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	248.048	0,61	
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>TÜRKEI, insgesamt</b>				<b>1.249.145</b>	<b>3,05</b>	
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	366.250	0,89	USD	230.000	Turkcell İletişim Hizmetleri AS 5.75% 15/10/2025	220.741	0,54	
USD	200.000	Saudi Arabian Oil Company 2.25% 24/11/2030	183.125	0,45	USD	200.000	Türkiye Garanti Bankası AS 5.88% 16/03/2023	202.600	0,49	
USD	400.000	Saudi Arabian Oil Company 3.50% 16/04/2029	403.700	0,98	<b>Türkei, insgesamt</b>			<b>1.249.145</b>	<b>3,05</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>			
USD	700.000 DP World Limited 6.85% 02/07/2037	844.522	2,06	USD	380.000 Dominican Republic (Govt of) 6.85% 27/01/2045	378.721	0,92
	<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>	<b>844.522</b>	<b>2,06</b>		<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>	<b>378.721</b>	<b>0,92</b>
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>			
USD	400.000 Endeavour Mining plc 5.00% 14/10/2026	370.074	0,90	USD	400.000 South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	392.279	0,96
USD	300.000 Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	126.375	0,31		<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>392.279</b>	<b>0,96</b>
USD	450.000 Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	138.572	0,34		<b>TÜRKEI</b>		
USD	200.000 Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	167.010	0,41	USD	200.000 Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	198.357	0,48
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>802.031</b>	<b>1,96</b>		<b>Türkei, insgesamt</b>	<b>198.357</b>	<b>0,48</b>
<b>BRITISCHE JUNGFERNSISELN</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>			
USD	460.000 Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	458.275	1,12		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>38.789.186</b>	<b>94,61</b>
USD	400.000 Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	354.729	0,86	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
USD	400.000 Elect Global Investments Limited Perp FRN	387.267	0,95	<b>Anleihen</b>			
USD	450.000 FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	452.076	1,10	<b>BERMUDAS</b>			
USD	400.000 Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	434.216	1,06	USD	500.000 Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	445.288	1,09
USD	511.000 HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	491.389	1,20		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>445.288</b>	<b>1,09</b>
USD	728.000 Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	711.484	1,74	<b>LUXEMBURG</b>			
USD	400.000 Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	306.988	0,75	USD	500.000 Altice Financing SA 5.00% 15/01/2028	451.237	1,10
USD	200.000 Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	184.136	0,45		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>451.237</b>	<b>1,10</b>
USD	467.000 Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	431.596	1,05	<b>Anleihen, insgesamt</b>			
	<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>	<b>4.212.156</b>	<b>10,28</b>	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>37.819.829</b>	<b>92,25</b>			<b>896.525</b>	<b>2,19</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
13.687	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	13.687	0,03
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>13.687</b>	<b>0,03</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>13.687</b>	<b>0,03</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>13.687</b>	<b>0,03</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>39.699.398</b>	<b>96,83</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 43.534.673)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>INSEL MAN</b>					
USD	200.000	Ooredoo International Finance Limited 2.63% 08/04/2031	187.585	0,53	USD	200.000	AngloGold Ashanti Holdings plc 3.75% 01/10/2030	187.108	0,53
<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>187.585</b>	<b>0,53</b>	<b>Insel Man, insgesamt</b>			<b>187.108</b>	<b>0,53</b>
<b>KANADA</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
USD	316.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	326.690	0,93	USD	253.000	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.63% 31/03/2036	227.836	0,65
<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>326.690</b>	<b>0,93</b>	USD	272.183	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.94% 30/09/2040	247.205	0,70
					<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>			<b>475.041</b>	<b>1,35</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>KASACHSTAN</b>					
USD	200.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	196.450	0,56	USD	200.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 19/04/2027	192.604	0,55
USD	200.000	SA Global Sukuk Limited 2.69% 17/06/2031	190.222	0,54	USD	600.000	KazMunayGas National Company JSC 5.38% 24/04/2030	578.265	1,65
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>386.672</b>	<b>1,10</b>	<b>Kasachstan, insgesamt</b>			<b>770.869</b>	<b>2,20</b>
<b>HONGKONG</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
USD	400.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	419.463	1,19	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	190.974	0,54
USD	210.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	181.967	0,52	<b>Luxemburg, insgesamt</b>			<b>190.974</b>	<b>0,54</b>
<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>601.430</b>	<b>1,71</b>					
<b>INDIEN</b>				<b>MALAYSIA</b>					
USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	195.160	0,55	USD	200.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	203.985	0,58
<b>Indien, insgesamt</b>			<b>195.160</b>	<b>0,55</b>	<b>Malaysia, insgesamt</b>			<b>203.985</b>	<b>0,58</b>
<b>INDONESIEN</b>				<b>MEXIKO</b>					
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5.45% 15/05/2030	470.899	1,34	USD	450.000	Comision Federal de Electricidad 3.88% 26/07/2033	396.332	1,13
USD	450.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	502.375	1,43	USD	300.000	Petroleos Mexicanos 5.95% 28/01/2031	277.148	0,79
USD	200.000	Pelabuhan Indonesia II 5.38% 05/05/2045	216.465	0,62	USD	200.000	Petroleos Mexicanos 6.38% 23/01/2045	159.833	0,45
<b>Indonesien, insgesamt</b>			<b>1.189.739</b>	<b>3,39</b>	USD	1.500.000	Petroleos Mexicanos 6.70% 16/02/2032	1.425.937	4,06
					USD	200.000	Petroleos Mexicanos 7.69% 23/01/2050	176.325	0,50
					<b>Mexiko, insgesamt</b>			<b>2.435.575</b>	<b>6,93</b>
<b>IRLAND</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
USD	200.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	59.150	0,17	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	224.688	0,64
<b>Irland, insgesamt</b>			<b>59.150</b>	<b>0,17</b>					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>JUNGFERNINSELN</b>						
USD	400.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	412.591	1,17	USD	250.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 6.13% 15/05/2029	271.385	0,77	
USD	250.000	Syngenta Finance NV 5.68% 24/04/2048	273.125	0,78	USD	689.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	673.368	1,91	
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>910.404</b>	<b>2,59</b>	USD	200.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	174.644	0,50	
				<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>				<b>1.119.397</b>	<b>3,18</b>	
				<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>11.838.150</b>	<b>33,66</b>	
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS-Anleihen</b>						
USD	250.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	230.344	0,65	<b>LUXEMBURG</b>					
		<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>230.344</b>	<b>0,65</b>	USD	180.000	Millicom International Cellular SA 5.13% 15/01/2028	179.604	0,51	
				<b>Luxemburg, insgesamt</b>				<b>179.604</b>	<b>0,51</b>	
<b>KATAR</b>				<b>Hypothekenbesicherte Anleihen und ABS- Anleihen, insgesamt</b>				<b>179.604</b>	<b>0,51</b>	
USD	356.000	Qatar Petroleum 2.25% 12/07/2031	328.873	0,93	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>					
		<b>Katar, insgesamt</b>	<b>328.873</b>	<b>0,93</b>	<b>ANGOLA</b>					
<b>SÜDAFRIKA</b>				USD 400.000				Angola (Govt of) 8.00% 26/11/2029	401.060	1,14
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	194.150	0,55	USD	200.000	Angola (Govt of) 9.38% 08/05/2048	197.336	0,56	
USD	200.000	Eskom Holdings SOC Limited 8.45% 10/08/2028	197.300	0,56			<b>Angola, insgesamt</b>	<b>598.396</b>	<b>1,70</b>	
		<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>391.450</b>	<b>1,11</b>	<b>ARGENTINIEN</b>					
<b>VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE</b>				USD 1.850.000				Argentina (Govt of) FRN 09/07/2035	565.638	1,62
USD	200.000	Abu Dhabi Ports Company Pjsc 2.50% 06/05/2031	185.411	0,53	USD	90.000	Argentina (Govt of) 1.13% 09/07/2046	28.288	0,08	
USD	700.000	DP World Limited 6.85% 02/07/2037	844.522	2,40			<b>Argentinien, insgesamt</b>	<b>593.926</b>	<b>1,70</b>	
		<b>Vereinigte Arabische Emirate, insgesamt</b>	<b>1.029.933</b>	<b>2,93</b>	<b>BAHRAIN</b>					
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				USD 300.000				Bahrain (Govt of) 5.63% 18/05/2034	285.950	0,81
USD	204.000	Gazprom PJSC Via Gaz Finance plc 3.25% 25/02/2030	85.935	0,24	USD	333.000	CBB International Sukuk Programme Company 3.88% 18/05/2029	324.719	0,92	
USD	230.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	192.062	0,55			<b>Bahrain, insgesamt</b>	<b>610.669</b>	<b>1,73</b>	
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>277.997</b>	<b>0,79</b>	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				USD 378.000				Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	339.774	0,97
USD	378.000	Petroleos Mexicanos 6.63% 15/06/2035	339.774	0,97			<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>339.774</b>	<b>0,97</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>WEISSRUSSLAND</b>				<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK (Fortsetzung)</b>					
USD	200.000	Belarus (Govt of) 6.20% 28/02/2030	33.065	0,09	USD	314.000	Dominican Republic (Govt of) 7.45% 30/04/2044	332.177	0,94
<b>Weissrussland, insgesamt</b>			<b>33.065</b>	<b>0,09</b>	<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>			<b>1.037.490</b>	<b>2,94</b>
<b>BRASILIEN</b>				<b>ECUADOR</b>					
USD	850.000	Brazil (Govt of) 3.88% 12/06/2030	785.855	2,24	USD	192.950	Ecuador (Govt of) 0.50% 31/07/2040	110.946	0,32
USD	200.000	Brazil (Govt of) 5.00% 27/01/2045	178.778	0,51	USD	485.835	Ecuador (Govt of) 1.00% 31/07/2035	319.354	0,90
<b>Brasilien, insgesamt</b>			<b>964.633</b>	<b>2,75</b>	USD	230.000	Ecuador (Govt of) 5.00% 31/07/2030	192.412	0,55
<b>Chile, insgesamt</b>			<b>183.780</b>	<b>0,52</b>	<b>Ecuador, insgesamt</b>			<b>622.712</b>	<b>1,77</b>
<b>CHILE</b>				<b>ÄGYPTEN</b>					
USD	200.000	Chile (Govt of) 3.50% 25/01/2050	183.780	0,52	EUR	180.000	Egypt (Govt of) 5.63% 16/04/2030	169.171	0,48
<b>China, insgesamt</b>			<b>197.361</b>	<b>0,56</b>	EUR	200.000	Egypt (Govt of) 6.38% 11/04/2031	191.172	0,54
<b>CHINA</b>				<b>EL SALVADOR</b>					
USD	200.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	197.361	0,56	USD	200.000	El Salvador (Govt of) 6.38% 18/01/2027	99.359	0,28
<b>China, insgesamt</b>			<b>197.361</b>	<b>0,56</b>	<b>El salvador, insgesamt</b>			<b>99.359</b>	<b>0,28</b>
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>GHANA</b>					
USD	1.000.000	Colombia (Govt of) 3.00% 30/01/2030	861.709	2,46	USD	364.000	Ghana (Govt of) 8.88% 07/05/2042	255.056	0,73
USD	350.000	Colombia (Govt of) 3.13% 15/04/2031	297.055	0,84	<b>Ghana, insgesamt</b>			<b>255.056</b>	<b>0,73</b>
USD	223.000	Colombia (Govt of) 3.25% 22/04/2032	187.341	0,53	<b>GUATEMALA</b>				
<b>Kolumbien, insgesamt</b>			<b>1.346.105</b>	<b>3,83</b>	USD	250.000	Guatemala (Govt of) 6.13% 01/06/2050	261.651	0,74
<b>KROATIEN</b>				<b>INDIEN</b>					
USD	200.000	Croatia (Govt of) 6.00% 26/01/2024	211.305	0,60	USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	377.942	1,07
<b>Kroatien, insgesamt</b>			<b>211.305</b>	<b>0,60</b>	<b>Indien, insgesamt</b>			<b>377.942</b>	<b>1,07</b>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>INDIEN</b>					
USD	200.000	Dominican Republic (Govt of) 4.88% 23/09/2032	182.146	0,52	<b>Indien, insgesamt</b>			<b>377.942</b>	<b>1,07</b>
USD	191.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 22/02/2029	190.267	0,54					
USD	222.000	Dominican Republic (Govt of) 5.88% 30/01/2060	190.758	0,54					
USD	151.000	Dominican Republic (Govt of) 6.40% 05/06/2049	142.142	0,40					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>						
<b>INDONESIEN</b>				<b>PANAMA (Fortsetzung)</b>						
USD	400.000	Indonesia (Govt of) 3.70% 30/10/2049	386.194	1,10	USD	200.000	Panama (Govt of) 4.50% 19/01/2063	192.746	0,55	
USD	200.000	Indonesia (Govt of) 4.30% 31/03/2052	209.756	0,60	<b>Panama, insgesamt</b>			<b>661.323</b>	<b>1,88</b>	
USD	350.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 18/07/2047	376.196	1,07	<b>PARAGUAY</b>					
IDR	5.360.000.000	Indonesia (Govt of) 6.38% 15/04/2032	368.325	1,05	USD	340.000	Paraguay (Govt of) 5.60% 13/03/2048	349.956	0,99	
USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	198.393	0,56	USD	200.000	Paraguay (Govt of) 6.10% 11/08/2044	223.285	0,63	
<b>Indonesien, insgesamt</b>				<b>1.538.864</b>	<b>4,38</b>	<b>Paraguay, insgesamt</b>			<b>573.241</b>	<b>1,62</b>
<b>ELFENBEINKÜSTE</b>				<b>PERU</b>						
EUR	477.000	Ivory Coast (Govt of) 5.88% 17/10/2031	492.763	1,41	USD	132.000	Peru (Govt of) 3.00% 15/01/2034	124.092	0,35	
<b>Elfenbeinküste, insgesamt</b>				<b>492.763</b>	<b>1,41</b>	<b>Peru, insgesamt</b>			<b>124.092</b>	<b>0,35</b>
<b>MEXIKO</b>				<b>PHILIPPINEN</b>						
USD	650.000	Mexico (Govt of) 3.25% 16/04/2030	627.371	1,79	USD	339.000	Philippine (Govt of) 3.20% 06/07/2046	304.833	0,87	
USD	300.000	Mexico (Govt of) 4.60% 10/02/2048	287.018	0,82	<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>304.833</b>	<b>0,87</b>	
MXN	85.000	Mexico (Govt of) 8.50% 31/05/2029	429.507	1,22	<b>KATAR</b>					
<b>Mexiko, insgesamt</b>				<b>1.343.896</b>	<b>3,83</b>	USD	450.000	Qatar (Govt of) 3.75% 16/04/2030	476.232	1,35
<b>OMAN</b>				<b>RUMÄNIEN</b>						
USD	200.000	Oman (Govt of) 6.25% 25/01/2031	212.442	0,60	USD	300.000	Romania (Govt of) 4.00% 14/02/2051	261.031	0,74	
<b>Oman, insgesamt</b>				<b>212.442</b>	<b>0,60</b>	USD	252.000	Romanian (Govt of) 3.00% 27/02/2027	245.557	0,70
<b>PAKISTAN</b>				<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>						
USD	200.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	157.514	0,45	USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	39.375	0,11	
<b>Pakistan, insgesamt</b>				<b>157.514</b>	<b>0,45</b>	USD	200.000	Russia (Govt of) 5.10% 28/03/2035	39.375	0,11
<b>PANAMA</b>				<b>Russische Föderation, insgesamt</b>						
USD	200.000	Panama (Govt of) 2.25% 29/09/2032	177.430	0,50				<b>78.750</b>	<b>0,22</b>	
USD	302.000	Panama (Govt of) 3.30% 19/01/2033	291.147	0,83						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen</b>					
<b>SAUDI-ARABIEN</b>				<b>VENEZUELA</b>					
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.45% 02/02/2061	444.423	1,26	USD	1.999.683	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	144.977	0,41
USD	500.000	Saudi (Govt of) 3.75% 21/01/2055	482.061	1,37	<b>Venezuela, insgesamt</b>				
USD	285.000	Saudi (Govt) 4.50% 26/10/2046	300.844	0,86	<b>Anleihen, insgesamt</b>				
<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>				<b>1.227.328</b>	<b>3,49</b>	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>VENEZUELA</b>					
USD	500.000	South Africa (Govt of) 5.75% 30/09/2049	438.457	1,25	USD	2.004.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	170.374	0,48
<b>Südafrika, insgesamt</b>				<b>438.457</b>	<b>1,25</b>	<b>Venezuela, insgesamt</b>			
<b>SRI LANKA</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					
USD	200.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	96.187	0,27	<b>170.374</b>				
<b>Sri Lanka, insgesamt</b>				<b>96.187</b>	<b>0,27</b>	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
<b>TÜRKEI</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					
USD	250.000	Turkey (Govt of) 4.25% 14/04/2026	225.876	0,64	<b>Anleihen</b>				
USD	430.000	Turkey (Govt of) 5.13% 17/02/2028	379.235	1,08	<b>LUXEMBURG</b>				
USD	625.000	Turkey (Govt of) 6.00% 25/03/2027	582.991	1,67	USD	210.000	Hidrovias International Finance Sarl 4.95% 08/02/2031	177.319	0,50
USD	250.000	Turkey (Govt of) 6.88% 17/03/2036	223.604	0,64	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
<b>Türkei, insgesamt</b>				<b>1.411.706</b>	<b>4,03</b>	<b>Anleihen, insgesamt</b>			
<b>UKRAINE</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>					
USD	518.000	Ukraine (Govt of) 6.88% 21/05/2029	219.618	0,62	<b>177.319</b>				
USD	560.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	242.931	0,69	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				
<b>Ukraine, insgesamt</b>				<b>462.549</b>	<b>1,31</b>	<b>31.587.064</b>			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>19.569.310</b>	<b>55,64</b>	<b>89,81</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
1.558.132	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	1.558.132	4,43
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.558.132</b>	<b>4,43</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>1.558.132</b>	<b>4,43</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>1.558.132</b>	<b>4,43</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>33.637.866</b>	<b>95,63</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 38.341.562)</b>			

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>BERMUDAS</b>				<b>INDIEN (Fortsetzung)</b>					
USD	1.000.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	1.008.375	1,11	USD	600.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	615.190	0,67
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>1.008.375</b>	<b>1,11</b>	USD	700.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	642.505	0,71
<b>BRASILIEN</b>				<b>Indien, insgesamt</b>					
USD	208.000	Cemig Geracao e Transmissao SA 9.25% 05/12/2024	226.330	0,25	<b>2.745.875</b>				
USD	1.200.000	Light Servicos de Eletricidade SA 4.38% 18/06/2026	1.120.500	1,23	<b>3,01</b>				
		<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>1.346.830</b>	<b>1,48</b>	<b>INDONESIEN</b>				
<b>KANADA</b>				<b>INDONESIEN</b>					
USD	1.650.000	MEGlobal Canada ULCDL 5.00% 18/05/2025	1.705.819	1,87	USD	3.000.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 4.75% 15/05/2025	3.077.249	3,38
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>1.705.819</b>	<b>1,87</b>	USD	464.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	456.699	0,50
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Indonesien, insgesamt</b>					
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	508.671	0,55	USD	1.200.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	146.005	0,16
USD	1.500.000	DP World Salaam Perp FRN	1.553.966	1,71	<b>3.679.953</b>				
USD	820.000	Energuate Trust 5.88% 03/05/2027	805.445	0,88	<b>4,04</b>				
USD	1.300.000	Sa Global Sukuk Limited 1.60% 17/06/2026	1.225.188	1,34	<b>IRLAND</b>				
USD	500.000	Vale Overseas Limited 6.25% 10/08/2026	549.163	0,60	USD	800.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding Dac 3.05% 23/01/2025	238.680	0,26
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>4.642.433</b>	<b>5,08</b>	USD	400.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 2.60% 16/09/2028	118.300	0,13
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>Irland, insgesamt</b>					
USD	500.000	Ecopetrol SA 5.88% 18/09/2023	511.813	0,56	<b>356.980</b>				
		<b>Kolumbien, insgesamt</b>	<b>511.813</b>	<b>0,56</b>	<b>0,39</b>				
<b>HONGKONG</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
USD	1.800.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	1.887.582	2,07	USD	1.669.858	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 1.75% 30/09/2027	1.609.497	1,77
		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>1.887.582</b>	<b>2,07</b>	<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>				
<b>INDIEN</b>				<b>KASACHSTAN</b>					
USD	1.000.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	983.461	1,08	USD	1.000.000	KazMunayGas National Company JSC 4.75% 24/04/2025	976.116	1,07
USD	500.000	GMR Hyderabad International Airport Limited 5.38% 10/04/2024	504.719	0,55	<b>Kasachstan, insgesamt</b>				
					<b>976.116</b>				
<b>LUXEMBURG</b>				<b>LUXEMBURG</b>					
USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	211.875	0,23	USD	500.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 5.15% 11/02/2026	211.875	0,23
USD	1.145.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	1.070.667	1,18	USD	1.145.000	Millicom International Cellular SA 4.50% 27/04/2031	1.070.667	1,18
USD	360.000	Millicom International Cellular SA 6.25% 25/03/2029	381.947	0,42	USD	1.000.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	1.001.998	1,10
USD	1.000.000	Rumo Luxembourg Sarl 5.25% 10/01/2028	1.001.998	1,10	<b>Luxemburg, insgesamt</b>				
					<b>2.666.487</b>				
					<b>2,93</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>MAURITIUS</b>				<b>SAUDI-ARABIEN</b>					
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	403.541	0,44	USD	350.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	349.301	0,38
USD	1.000.000	HTA Group Limited/Mauritius 7.00% 18/12/2025	988.750	1,09	USD	450.000	Saudi Arabian Oil Company 2.88% 16/04/2024	449.101	0,49
<b>Mauritius, insgesamt</b>			<b>1.392.291</b>	<b>1,53</b>	<b>Saudi-Arabien, insgesamt</b>			<b>798.402</b>	<b>0,87</b>
<b>MEXIKO</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>					
USD	500.000	Cemex SAB de CV 5.20% 17/09/2030	497.810	0,55	USD	1.400.000	Eskom Holdings 6.75% 06/08/2023	1.383.317	1,51
USD	1.000.000	Cemex SAB de CV 7.38% 05/06/2027	1.070.375	1,17	USD	500.000	Eskom Holdings SOC Limited 7.13% 11/02/2025	485.375	0,53
USD	1.200.000	Petroleos Mexicanos 4.25% 15/01/2025	1.184.827	1,30	<b>Südafrika, insgesamt</b>			<b>1.868.692</b>	<b>2,04</b>
USD	1.100.000	Petroleos Mexicanos 6.49% 23/01/2027	1.117.562	1,23	<b>TÜRKEI</b>				
USD	800.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 16/10/2025	837.720	0,92	USD	950.000	Turk Telekomunikasyon AS 6.88% 28/02/2025	942.582	1,03
USD	2.600.000	Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	2.724.994	2,99	<b>Türkei, insgesamt</b>			<b>942.582</b>	<b>1,03</b>
<b>Mexiko, insgesamt</b>			<b>7.433.288</b>	<b>8,16</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					
USD	911.800	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	869.021	0,96	USD	860.000	Endeavour Mining plc 5.00% 14/10/2026	795.659	0,87
USD	500.000	Metinvest BV 8.50% 23/04/2026	223.366	0,25	USD	200.000	Nak Naftogaz Ukraine Via Kondor Finance plc 7.63% 08/11/2026	61.588	0,07
USD	1.000.000	Syngenta Finance NV 4.44% 24/04/2023	1.011.589	1,11	USD	600.000	Tullow Oil plc 7.00% 01/03/2025	501.031	0,55
USD	900.000	Syngenta Finance NV 5.18% 24/04/2028	928.329	1,02	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>1.358.278</b>	<b>1,49</b>
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>3.032.305</b>	<b>3,34</b>	<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				
<b>PERU</b>				<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					
USD	1.000.000	Auna SA 6.50% 20/11/2025	975.095	1,07	USD	1.000.000	Central American Bottling Corp. 5.25% 27/04/2029	996.250	1,09
USD	479.000	Hunt Oil Company of Peru LLC Sucursal del Peru 6.38% 01/06/2028	479.802	0,53	USD	400.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	387.267	0,43
<b>Peru, insgesamt</b>			<b>1.454.897</b>	<b>1,60</b>	USD	1.700.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	1.738.769	1,91
<b>PHILIPPINEN</b>				<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>					
USD	893.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	854.764	0,94	USD	500.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.00% 05/08/2025	467.532	0,51
USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	617.321	0,68	USD	1.500.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	1.381.018	1,52
<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>1.472.085</b>	<b>1,62</b>	USD	1.133.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	1.047.104	1,15
<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>1.472.085</b>	<b>1,62</b>	<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>			<b>6.017.940</b>	<b>6,61</b>
<b>Anleihen, insgesamt</b>						<b>48.908.520</b>	<b>53,67</b>		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>ANGOLA</b>				<b>EL SALVADOR</b>					
USD	500.000	Angola (Govt of) 8.25% 09/05/2028	511.194	0,56	USD	300.000	El Salvador (Govt of) 5.88% 30/01/2025	168.750	0,19
USD	1.050.000	Angola (Govt of) 9.50% 12/11/2025	1.154.077	1,27			<b>El salvador, insgesamt</b>	<b>168.750</b>	<b>0,19</b>
		<b>Angola, insgesamt</b>	<b>1.665.271</b>	<b>1,83</b>					
<b>WEISSRUSSLAND</b>				<b>GHANA</b>					
USD	1.202.000	Belarus (Govt of) 6.88% 28/02/2023	205.513	0,23	USD	1.200.000	Ghana (Govt of) 6.38% 11/02/2027	904.638	0,99
		<b>Weissrussland, insgesamt</b>	<b>205.513</b>	<b>0,23</b>			<b>Ghana, insgesamt</b>	<b>904.638</b>	<b>0,99</b>
<b>BRASILIEN</b>				<b>GUATEMALA</b>					
USD	2.000.000	Brazil (Govt of) 2.88% 06/06/2025	1.966.042	2,16	USD	745.000	Guatemala (Govt of) 5.75% 06/06/2022	749.437	0,82
USD	1.400.000	Brazil (Govt of) 4.25% 07/01/2025	1.445.438	1,59			<b>Guatemala, insgesamt</b>	<b>749.437</b>	<b>0,82</b>
		<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>3.411.480</b>	<b>3,75</b>					
<b>KOLUMBIEN</b>				<b>INDONESIEN</b>					
USD	1.300.000	Colombia (Govt of) 4.00% 26/02/2024	1.303.933	1,43	USD	250.000	Indonesia (Govt of) 4.13% 15/01/2025	258.952	0,28
		<b>Kolumbien, insgesamt</b>	<b>1.303.933</b>	<b>1,43</b>			<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>258.952</b>	<b>0,28</b>
<b>COSTA RICA</b>				<b>OMAN</b>					
USD	300.000	Costa Rica (Govt of) 4.38% 30/04/2025	304.778	0,33	USD	1.000.000	Oman (Govt of) 4.40% 01/06/2024	1.012.912	1,11
		<b>Costa Rica, insgesamt</b>	<b>304.778</b>	<b>0,33</b>	USD	1.700.000	Oman (Govt of) 4.75% 15/06/2026	1.709.851	1,88
							<b>Oman, insgesamt</b>	<b>2.722.763</b>	<b>2,99</b>
<b>DOMINIKANISCHE REPUBLIK</b>				<b>PAKISTAN</b>					
USD	1.700.000	Dominican Republic (Govt of) 5.50% 27/01/2025	1.765.808	1,94	USD	500.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	384.788	0,42
USD	1.000.000	Dominican Republic (Govt of) 6.85% 29/01/2026	1.066.863	1,17	USD	700.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	573.283	0,63
		<b>Dominikanische Republik, insgesamt</b>	<b>2.832.671</b>	<b>3,11</b>			<b>Pakistan, insgesamt</b>	<b>958.071</b>	<b>1,05</b>
<b>ÄGYPTEN</b>				<b>PANAMA</b>					
USD	700.000	Egypt (Govt of) 3.88% 16/02/2026	630.043	0,69	USD	1.350.000	Panama (Govt of) 3.75% 16/03/2025	1.377.179	1,51
USD	1.750.000	Egypt (Govt of) 5.25% 06/10/2025	1.696.428	1,86			<b>Panama, insgesamt</b>	<b>1.377.179</b>	<b>1,51</b>
USD	600.000	Egypt (Govt of) 5.75% 29/05/2024	598.493	0,66					
USD	1.300.000	Egypt (Govt of) 5.88% 11/06/2025	1.285.137	1,41					
		<b>Ägypten, insgesamt</b>	<b>4.210.101</b>	<b>4,62</b>					
				<b>KATAR</b>					
					USD	2.700.000	Qatar (Govt of) 3.25% 02/06/2026	2.751.796	3,03
							<b>Katar, insgesamt</b>	<b>2.751.796</b>	<b>3,03</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen</b>					
<b>RUMÄNIEN</b>				<b>BERMUDAS</b>					
USD	646.000	Romanian (Govt of) 3.00% 27/02/2027	629.484	0,69	USD	1.000.000	Tengizchevroil Finance Company International 2.63% 15/08/2025	890.575	0,98
		<b>Rumänien, insgesamt</b>	<b>629.484</b>	<b>0,69</b>			<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>890.575</b>	<b>0,98</b>
<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>				<b>VENEZUELA</b>					
USD	400.000	Russia (Govt of) 4.75% 27/05/2026	104.056	0,11	USD	3.288.783	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 16/05/2024	238.437	0,26
		<b>Russische Föderation, insgesamt</b>	<b>104.056</b>	<b>0,11</b>	USD	491.751	Petroleos de Venezuela SA 6.00% 15/11/2026	35.652	0,04
							<b>Venezuela, insgesamt</b>	<b>274.089</b>	<b>0,30</b>
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Anleihen, insgesamt</b>					
USD	350.000	South Africa (Govt of) 4.85% 30/09/2029	343.244	0,38				<b>1.164.664</b>	<b>1,28</b>
USD	600.000	South Africa (Govt of) 4.88% 14/04/2026	612.343	0,67	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				
		<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>955.587</b>	<b>1,05</b>	<b>VENEZUELA</b>				
<b>TÜRKEI</b>				<b>VENEZUELA</b>					
USD	1.200.000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama Anonim Sirketi 7.25% 24/02/2027	1.205.595	1,32	USD	1.245.400	Venezuela (Govt of) 8.25% 13/10/2024	105.859	0,12
USD	900.000	Turkey (Govt of) 4.75% 26/01/2026	832.447	0,91			<b>Venezuela, insgesamt</b>	<b>105.859</b>	<b>0,12</b>
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 4.88% 09/10/2026	996.857	1,09	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				
USD	1.673.000	Turkey (Govt of) 5.60% 14/11/2024	1.629.759	1,79	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				
USD	1.100.000	Turkey (Govt of) 5.75% 22/03/2024	1.090.962	1,20				<b>1.270.523</b>	<b>1,40</b>
USD	1.700.000	Turkey (Govt of) 7.38% 05/02/2025	1.724.774	1,89	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
		<b>Türkei, insgesamt</b>	<b>7.480.394</b>	<b>8,20</b>	<b>Fonds</b>				
<b>UKRAINE</b>				<b>IRLAND</b>					
USD	2.534.000	Ukraine (Govt of) 7.75% 01/09/2026	1.099.261	1,21	3.521.464	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.521.464	3,87	
		<b>Ukraine, insgesamt</b>	<b>1.099.261</b>	<b>1,21</b>			<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.521.464</b>	<b>3,87</b>
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>34.094.115</b>	<b>37,42</b>	<b>Fonds, insgesamt</b>			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>83.002.635</b>	<b>91,09</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
						<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
						<b>87.794.622</b>			
						<b>96,36</b>			
						<b>(Gesamtkosten: USD 96.749.454)</b>			

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>KANADA</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>						
USD	437.000	Bombardier Inc. 7.88% 15/04/2027	428.634	0,24	USD	738.000	Ziggo BV 4.88% 15/01/2030	697.636	0,40	
USD	316.000	Nova Chemicals Corp. 4.25% 15/05/2029	292.150	0,17	<b>Niederlande, insgesamt</b>					
<b>Kanada, insgesamt</b>				<b>720.784</b>	<b>0,41</b>	<b>PANAMA</b>				
<b>FRANKREICH</b>				<b>PANAMA</b>						
USD	504.000	Altice France SA 5.13% 15/07/2029	450.815	0,26	USD	342.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	345.061	0,20	
USD	311.000	Altice France SA 5.50% 15/01/2028	288.243	0,16	<b>Panama, insgesamt</b>					
USD	581.000	Altice France SA 8.13% 01/02/2027	599.519	0,34	<b>Polen</b>					
<b>Frankreich, insgesamt</b>				<b>1.338.577</b>	<b>0,76</b>	<b>POLEN</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>POLEN</b>						
USD	384.000	Iho Verwaltungs GmbH 6.38% 15/05/2029	380.032	0,22	USD	649.000	Canpack SA 3.88% 15/11/2029	571.792	0,32	
USD	261.000	IHO Verwaltungs GmbH 4.75% 15/09/2026	260.266	0,15	<b>Polen, insgesamt</b>					
<b>Deutschland, insgesamt</b>				<b>640.298</b>	<b>0,37</b>	<b>Spanien</b>				
<b>LIBERIA</b>				<b>SPANIEN</b>						
USD	453.000	Royal Caribbean Cruises Limited 3.70% 15/03/2028	404.189	0,23	USD	147.000	Grifols Escrow Issuer SA 4.75% 15/10/2028	139.419	0,08	
USD	147.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.25% 15/11/2022	149.098	0,08	<b>Spanien, insgesamt</b>					
USD	402.000	Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 01/04/2028	383.876	0,22	<b>SUPRANATIONAL</b>					
<b>Liberia, insgesamt</b>				<b>937.163</b>	<b>0,53</b>	USD	368.000	Ardagh Packaging Finance plc 5.25% 15/08/2027	340.556	0,19
<b>LUXEMBURG</b>				<b>SUPRANATIONAL</b>						
USD	486.000	Herens Holdco Sarl 4.75% 15/05/2028	438.021	0,25	<b>Supranational, insgesamt</b>					
<b>Luxemburg, insgesamt</b>				<b>438.021</b>	<b>0,25</b>	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
USD	375.000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% 15/08/2026	374.419	0,21	USD	122.000	Allegheny Technologies Inc. 4.88% 01/10/2029	115.637	0,07	
USD	88.000	Trivium Packaging Finance BV 8.50% 15/08/2027	88.233	0,05	USD	506.000	Allegheny Technologies Inc. 5.13% 01/10/2031	479.163	0,27	
USD	171.000	Ziggo Bond Finance BV 6.00% 15/01/2027	172.913	0,10	USD	191.000	American Axle & Manufacturing Inc. 6.50% 01/04/2027	188.535	0,11	
				<b>US, insgesamt</b>						
				<b>720.784</b>	<b>0,41</b>	USD	744.000	Apache Corp. 4.75% 15/04/2043	707.023	0,40
				<b>640.298</b>	<b>0,37</b>	USD	311.000	Apache Corp. 5.10% 01/09/2040	314.592	0,18
				<b>937.163</b>	<b>0,53</b>	USD	275.000	Apache Corp. 5.25% 01/02/2042	275.197	0,16
				<b>438.021</b>	<b>0,25</b>	USD	102.000	Bath & Body Works Inc. 5.25% 01/02/2028	102.765	0,06
				<b>438.021</b>	<b>0,25</b>	USD	169.000	Bath & Body Works Inc. 6.88% 01/11/2035	174.281	0,10
				<b>937.163</b>	<b>0,53</b>	USD	221.000	Bath & Body Works Inc. 7.50% 15/06/2029	239.675	0,14
				<b>438.021</b>	<b>0,25</b>	USD	285.000	Centene Corp. 2.63% 01/08/2031	254.006	0,14
				<b>937.163</b>	<b>0,53</b>	USD	278.000	Centene Corp. 3.00% 15/10/2030	256.180	0,15
				<b>438.021</b>	<b>0,25</b>	USD	252.000	DCP Midstream Operating LP 5.13% 15/05/2029	259.718	0,15
				<b>937.163</b>	<b>0,53</b>	USD	155.000	DCP Midstream Operating LP 5.60% 01/04/2044	162.944	0,09

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
USD	91.000 Delta Air Lines Inc. 4.38% 19/04/2028	87.474	0,05	USD	996.000 Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/04/2046	949.952	0,55
USD	482.000 Delta Air Lines Inc. 7.38% 15/01/2026	522.265	0,30	USD	296.000 Occidental Petroleum Corp. 4.40% 15/08/2049	280.180	0,16
USD	142.000 Encompass Health Corp. 4.50% 01/02/2028	139.515	0,08	USD	54.000 Occidental Petroleum Corp. 4.63% 15/06/2045	52.515	0,03
USD	349.000 EQM Midstream Partner LP 5.50% 15/07/2028	351.422	0,20	USD	646.000 Occidental Petroleum Corp. 6.13% 01/01/2031	727.834	0,41
USD	159.000 Firstenergy Corp. 5.60% 15/07/2047	166.960	0,09	USD	417.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	479.029	0,27
USD	140.000 FirstEnergy Corp. 7.38% 15/11/2031	173.065	0,10	USD	156.000 Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	179.205	0,10
USD	328.000 Ford Motor Company 3.25% 12/02/2032	293.152	0,17	USD	163.000 Occidental Petroleum Corp. 7.50% 01/05/2031	199.678	0,11
USD	182.000 Ford Motor Company 4.75% 15/01/2043	165.393	0,09	USD	288.000 OneMain Finance Corp. 5.63% 15/03/2023	293.333	0,17
USD	385.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.70% 10/08/2026	357.825	0,20	USD	216.000 OneMain Finance Corp. 6.13% 15/03/2024	221.535	0,13
USD	257.000 Ford Motor Credit Company LLC 2.90% 16/02/2028	232.806	0,13	USD	189.000 OneMain Finance Corp. 6.88% 15/03/2025	198.941	0,11
USD	402.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.38% 13/11/2025	390.630	0,22	USD	220.000 PG&E Corp. 5.00% 01/07/2028	213.032	0,12
USD	771.000 Ford Motor Credit Company LLC 3.66% 08/09/2024	764.832	0,43	USD	471.000 Primo Water Holdings Inc. 4.38% 30/04/2029	426.915	0,24
USD	378.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.00% 13/11/2030	356.435	0,20	USD	146.000 Radian Group Inc. 4.88% 15/03/2027	147.296	0,08
USD	622.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.39% 08/01/2026	620.833	0,36	USD	212.000 Radian Group Inc. 6.63% 15/03/2025	223.246	0,13
USD	244.000 Ford Motor Credit Company LLC 4.95% 28/05/2027	248.557	0,14	USD	138.000 Service Properties Trust 4.35% 01/10/2024	133.239	0,08
USD	455.000 Ford Motor Credit Company LLC 5.11% 03/05/2029	458.788	0,26	USD	174.000 SM Energy Company 6.75% 15/09/2026	179.155	0,10
USD	429.000 HB Fuller Company 4.25% 15/10/2028	402.563	0,23	USD	894.000 Southwestern Energy Company 4.75% 01/02/2032	895.676	0,51
USD	320.000 HCA Inc. 5.63% 01/09/2028	346.200	0,20	USD	124.000 Sprint Capital Corp. 8.75% 15/03/2032	167.123	0,09
USD	336.000 HCA Inc. 5.88% 01/02/2029	369.390	0,21	USD	389.000 Targa Resources Partners LP 5.88% 15/04/2026	401.470	0,23
USD	254.000 Lumen Technologies Inc. 7.50% 01/04/2024	268.427	0,15	USD	57.000 Tenet Healthcare Corp. 4.25% 01/06/2029	54.898	0,03
USD	300.000 Mgc Investment Corp. 5.25% 15/08/2028	296.603	0,17	USD	378.000 T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	346.005	0,20
USD	476.000 Navient Corp. 6.75% 25/06/2025	489.661	0,28	USD	458.000 T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	432.238	0,25
USD	222.000 Nustar Logistics LP 5.75% 01/10/2025	227.334	0,13	USD	543.000 T-Mobile USA Inc. 3.50% 15/04/2031	512.307	0,29
USD	151.000 NuStar Logistics LP 5.63% 28/04/2027	148.811	0,08	USD	361.000 T-Mobile USA Inc. 4.75% 01/02/2028	367.958	0,21
USD	578.000 NuStar Logistics LP 6.00% 01/06/2026	586.676	0,33	USD	526.000 Transdigm Inc. 5.50% 15/11/2027	523.594	0,30
USD	245.000 Occidental Petroleum Corp. 4.20% 15/03/2048	229.938	0,13				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>CANADA (Fortsetzung)</b>					
USD	422.000	Transdigm Inc. 6.38% 15/06/2026	425.401	0,24	USD	425.000	Air Canada 3.88% 15/08/2026	401.625	0,23
USD	351.000	United Airlines Inc. 4.63% 15/04/2029	333.324	0,19	USD	161.000	Bausch Health Cos Inc. 4.88% 01/06/2028	154.359	0,09
USD	147.000	United Rentals North America Inc. 5.50% 15/05/2027	152.242	0,09	USD	265.000	Bausch Health Cos Inc. 5.00% 30/01/2028	219.288	0,12
USD	179.000	Vistra Operations Company LLC 4.38% 01/05/2029	169.226	0,10	USD	395.000	Bausch Health Cos Inc. 5.25% 30/01/2030	310.569	0,18
USD	169.000	Welbilt Inc. 9.50% 15/02/2024	170.658	0,10	USD	440.000	Bausch Health Cos Inc. 5.50% 01/11/2025	438.992	0,25
USD	331.000	Western Midstream Operating LP 4.65% 01/07/2026	339.311	0,19	USD	166.000	Clarios Global LP 6.75% 15/05/2025	172.313	0,10
USD	171.000	Western Midstream Operating LP 5.05% 01/02/2030	171.375	0,10	USD	195.000	GFL Environmental Inc. 3.50% 01/09/2028	183.583	0,10
USD	170.000	Western Midstream Operating LP 5.30% 01/03/2048	168.469	0,10	USD	390.000	GFL Environmental Inc. 3.75% 01/08/2025	383.714	0,22
USD	127.000	Yum! Brands Inc. 4.63% 31/01/2032	123.674	0,07	USD	127.000	GFL Environmental Inc. 4.25% 01/06/2025	126.383	0,07
USD	373.000	Yum! Brands Inc. 5.38% 01/04/2032	373.933	0,21	USD	74.000	GFL Environmental Inc. 4.75% 15/06/2029	70.583	0,04
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>23.259.238</b>	<b>13,24</b>	USD	265.000	GFL Environmental Inc. 5.13% 15/12/2026	267.442	0,15
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>30.064.110</b>	<b>17,11</b>	USD	658.000	Hudbay Minerals Inc. 4.50% 01/04/2026	641.004	0,36
		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>30.064.110</b>	<b>17,11</b>	USD	213.000	Hudbay Minerals Inc. 6.13% 01/04/2029	219.656	0,12
		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			USD	268.000	Nova Chemicals Corp. 5.25% 01/06/2027	266.995	0,15
		<b>Anleihen</b>			USD	371.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc. 5.38% 15/01/2025	377.420	0,21
		<b>BERMUDAS</b>			USD	278.000	Videotron Limited 3.63% 15/06/2029	257.650	0,15
USD	182.000	Nabors Industries Limited 7.25% 15/01/2026	182.677	0,10			<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>5.448.458</b>	<b>3,09</b>
USD	246.000	NCL Corp. Limited 5.88% 15/03/2026	234.008	0,13			<b>KAIMANINSELN</b>		
USD	126.000	NCL Finance Limited 6.13% 15/03/2028	116.865	0,07	USD	601.627	Hawaiian Brand Intellectual Property Limited 5.75% 20/01/2026	602.546	0,34
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>533.550</b>	<b>0,30</b>	USD	510.726	Transocean Sentry Limited 5.38% 15/05/2023	499.206	0,28
		<b>KANADA</b>					<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.101.752</b>	<b>0,62</b>
USD	570.000	1011778 BC ULC 3.88% 15/01/2028	540.304	0,31			<b>FRANKREICH</b>		
USD	286.000	1011778 BC ULC 4.00% 15/10/2030	258.548	0,15	USD	484.000	Altice France SA 5.50% 15/10/2029	437.657	0,25
USD	164.000	1011778 BC ULC 4.38% 15/01/2028	158.030	0,09	USD	558.000	Constellium SE 3.75% 15/04/2029	501.503	0,28
					USD	578.000	Constellium SE 5.63% 15/06/2028	582.208	0,33

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>			
USD	530.000 Iliad Holding SASU 6.50% 15/10/2026	531.716	0,30	USD	193.000 Constellium SE 5.88% 15/02/2026	193.691	0,11
USD	679.000 Iliad Holding SASU 7.00% 15/10/2028	680.966	0,39	<b>Niederlande, insgesamt</b>			
<b>Frankreich, insgesamt</b>				<b>2.734.050 1,55</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>PANAMA</b>			
USD	363.000 TK Elevator Holdco GmbH 7.63% 15/07/2028	364.528	0,21	USD	649.000 Carnival Corp. 4.00% 01/08/2028	605.193	0,34
<b>Deutschland, insgesamt</b>				USD	760.000 Carnival Corp. 5.75% 01/03/2027	724.849	0,42
<b>364.528 0,21</b>				USD	740.000 Carnival Corp. 6.00% 01/05/2029	698.374	0,40
<b>IRLAND</b>				<b>Panama, insgesamt</b>			
USD	504.000 James Hardie International Finance DAC 5.00% 15/01/2028	498.330	0,28	<b>2.028.416 1,16</b>			
<b>Irland, insgesamt</b>				<b>SUPRANATIONAL</b>			
<b>498.330 0,28</b>				USD	207.000 Clarios Global LP 6.25% 15/05/2026	213.735	0,12
<b>LIBERIA</b>				USD	501.000 Clarios Global LP 8.50% 15/05/2027	519.833	0,30
USD	306.000 Royal Caribbean Cruises Limited 4.25% 01/07/2026	285.154	0,16	<b>Supranational, insgesamt</b>			
USD	223.000 Royal Caribbean Cruises Limited 5.50% 31/08/2026	215.753	0,12	<b>733.568 0,42</b>			
USD	186.000 Royal Caribbean Cruises Limited 9.13% 15/06/2023	194.328	0,11	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
USD	102.000 Royal Caribbean Cruises Limited 11.50% 01/06/2025	112.136	0,06	USD	215.000 International Game Technology plc 4.13% 15/04/2026	212.447	0,12
<b>Liberia, insgesamt</b>				USD	313.000 International Game Technology plc P.P. 144A 6.50% 15/02/2025	329.479	0,19
<b>807.371 0,45</b>				USD	337.000 Virgin Media Finance plc 5.00% 15/07/2030	319.112	0,18
<b>LUXEMBURG</b>				USD	282.000 Virgin Media Secured Finance plc 4.50% 15/08/2030	263.360	0,15
USD	516.000 Altice France Holding SA 6.00% 15/02/2028	445.695	0,25	USD	788.000 Vmed O2 UK Financing 4.25% 31/01/2031	719.247	0,41
USD	372.000 Axalta Coating Systems LLC 4.75% 15/06/2027	357.650	0,20	USD	753.000 Vmed O2 UK Financing I plc 4.75% 15/07/2031	712.108	0,40
USD	477.000 Camelot Finance SA 4.50% 01/11/2026	466.820	0,27	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
USD	154.000 Endo Finance Company LLC 6.00% 30/06/2028	87.495	0,05	<b>2.555.753 1,45</b>			
USD	494.000 Fage International 5.63% 15/08/2026	491.431	0,28	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
USD	440.000 Ion Trading Technologies Sarl 5.75% 15/05/2028	427.845	0,24	USD	354.000 Acadia Healthcare Company Inc. 5.00% 15/04/2029	349.464	0,20
<b>Luxemburg, insgesamt</b>				USD	221.000 Acadia Healthcare Company Inc. 5.50% 01/07/2028	222.315	0,13
<b>2.276.936 1,29</b>				USD	96.000 AdaptHealth LLC 4.63% 01/08/2029	87.679	0,05
<b>NIEDERLANDE</b>				USD	720.000 AdaptHealth LLC 5.13% 01/03/2030	669.623	0,37
USD	187.000 Clear Channel International BV 6.63% 01/08/2025	191.678	0,11	USD	118.000 AG Issuer LLC 6.25% 01/03/2028	118.295	0,07
				USD	488.000 Albertsons Companies Inc. 3.25% 15/03/2026	461.475	0,26
				USD	487.000 Albertsons Companies Inc. 5.88% 15/02/2028	487.924	0,28

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
USD	141.000 Albertsons Companies Inc. 7.50% 15/03/2026	149.488	0,08	USD	298.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.13% 15/05/2029	275.650	0,16
USD	353.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 4.25% 15/10/2027	340.045	0,19	USD	306.000 Beacon Roofing Supply Inc. 4.50% 15/11/2026	305.560	0,17
USD	268.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 5.88% 01/11/2029	257.950	0,15	USD	202.000 Black Knight Infoserv LLC 3.63% 01/09/2028	191.743	0,11
USD	692.000 Alliant Holdings Intermediate LLC 6.75% 15/10/2027	685.304	0,39	USD	497.000 Blackstone Mortgage Trust Inc. 3.75% 15/01/2027	465.772	0,26
USD	1.141.121 American Airlines Inc. 5.50% 20/04/2026	1.152.533	0,65	USD	234.000 Boxer Parent Company Inc. 7.13% 02/10/2025	243.413	0,14
USD	606.110 American Airlines Inc. 5.75% 20/04/2029	603.657	0,34	USD	207.000 Boyd Gaming Corp. 4.75% 01/12/2027	205.368	0,12
USD	412.000 American Airlines Inc. 11.75% 15/07/2025	481.010	0,27	USD	275.000 Boyd Gaming Corp. 4.75% 15/06/2031	265.443	0,15
USD	619.000 American Builders & Contractors Supply Company Inc. 4.00% 15/01/2028	595.930	0,34	USD	674.000 BroadStreet Partners Inc. 5.88% 15/04/2029	630.190	0,36
USD	121.000 APX Group Inc. 6.75% 15/02/2027	123.989	0,07	USD	291.000 BWX Technologies Inc. 4.13% 30/06/2028	280.846	0,16
USD	174.000 Aramark Services Inc. 5.00% 01/02/2028	168.889	0,10	USD	199.000 Cablevision Lightpath LLC 3.88% 15/09/2027	186.381	0,11
USD	87.000 Aramark Services Inc. 6.38% 01/05/2025	89.364	0,05	USD	756.000 Caesars Entertainment Inc. 4.63% 15/10/2029	708.750	0,40
USD	148.000 Arches Buyer Inc. 4.25% 01/06/2028	138.148	0,08	USD	604.000 Caesars Entertainment Inc. 6.25% 01/07/2025	624.394	0,34
USD	303.000 Arches Buyer Inc. 6.13% 01/12/2028	280.579	0,16	USD	486.000 Caesars Entertainment Inc. 8.13% 01/07/2027	523.128	0,30
USD	257.000 Archrock Partners LP Archrock Partners Finance Corp. 6.25% 01/04/2028	253.457	0,14	USD	302.000 Caesars Resort Collection LLC 5.75% 01/07/2025	309.173	0,18
USD	739.000 Ardagh Metal Packaging 4.00% 01/09/2029	667.262	0,39	USD	1.182.000 Callon Petroleum Company 6.38% 01/07/2026	1.176.053	0,68
USD	165.000 Asbury Automotive Group Inc. 4.63% 15/11/2029	154.172	0,09	USD	204.000 Catalent Pharma Solutions 3.13% 15/02/2029	186.177	0,11
USD	255.000 Asbury Automotive Group Inc. 5.00% 15/02/2032	237.500	0,13	USD	343.000 CCO Holdings LLC 5.13% 01/05/2027	343.960	0,20
USD	174.000 ASP Unifrax Holdings Inc 5.25% 30/09/2028	162.186	0,09	USD	983.000 Cco Holdings LLC 4.25% 01/02/2031	897.271	0,52
USD	405.000 Assuredpartners Inc. 5.63% 15/01/2029	374.068	0,21	USD	188.000 CCO Holdings LLC 4.50% 01/05/2032	172.138	0,10
USD	539.000 Avantor Funding Inc. 3.88% 01/11/2029	509.400	0,29	USD	862.000 CCO Holdings LLC 4.75% 01/03/2030	830.214	0,47
USD	584.000 Avantor Funding Inc. 4.63% 15/07/2028	576.820	0,32	USD	428.000 CCO Holdings LLC 4.75% 01/02/2032	399.739	0,23
USD	314.000 Axalta Coating Systems LLC 3.38% 15/02/2029	276.383	0,16	USD	733.000 CCO Holdings LLC 5.00% 01/02/2028	726.522	0,41
USD	370.000 Bath & Body Works Inc. 6.63% 01/10/2030	388.963	0,22	USD	488.000 CD&R Smokey Buyer Inc. 6.75% 15/07/2025	505.080	0,28
USD	526.000 Bausch Health Americas Inc. 9.25% 01/04/2026	539.600	0,31	USD	244.000 Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company 5.50% 01/05/2025	250.861	0,14

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	272.000	Cedar Fair LP Canada's Wonderland Company Magnum Management Corp. Millennium Op 6.50% 01/10/2028	278.562	0,16	USD	173.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/01/2032	159.946	0,09
USD	527.000	Cengage Learning Inc. 9.50% 15/06/2024	526.094	0,30	USD	319.000	Clearway Energy Operating LLC 4.75% 15/03/2028	321.166	0,18
USD	221.000	Centene Corp. 3.38% 15/02/2030	208.475	0,12	USD	373.000	CNX Midstream Partners LP 4.75% 15/04/2030	350.804	0,20
USD	151.000	ChampionX Corp. 6.38% 01/05/2026	153.922	0,09	USD	317.000	Cnx Resources Corp. 6.00% 15/01/2029	321.755	0,18
USD	193.000	Change Healthcare Holdings LLC 5.75% 01/03/2025	193.121	0,11	USD	437.000	Cnx Resources Corp. 7.25% 14/03/2027	462.786	0,26
USD	159.000	Charles River Laboratories International Inc. 3.75% 15/03/2029	150.732	0,09	USD	198.000	CommScope Technologies LLC P.P. 144A 6.00% 15/06/2025	188.009	0,11
USD	52.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.00% 15/03/2031	49.215	0,03	USD	212.000	Comstock Resources Inc. 6.75% 01/03/2029	218.869	0,12
USD	161.000	Charles River Laboratories International Inc. 4.25% 01/05/2028	157.780	0,09	USD	190.000	CrownRock LP 5.00% 01/05/2029	190.616	0,11
USD	537.000	Cheniere Energy Inc. 4.63% 15/10/2028	540.316	0,31	USD	304.000	CSC Holdings LLC 3.38% 15/02/2031	256.500	0,15
USD	775.000	Cheniere Energy Partners LP 3.25% 31/01/2032	705.250	0,39	USD	420.000	CSC Holdings LLC 4.13% 01/12/2030	370.642	0,21
USD	247.000	Cheniere Energy Partners LP 4.00% 01/03/2031	240.047	0,14	USD	319.000	CSC Holdings LLC 4.63% 01/12/2030	266.660	0,15
USD	290.000	Cheniere Energy Partners LP 4.50% 01/10/2029	291.631	0,17	USD	330.000	CSC Holdings LLC 5.00% 15/11/2031	277.339	0,16
USD	123.000	CHS Community Health Systems Inc. 5.63% 15/03/2027	125.578	0,07	USD	207.000	CSC Holdings LLC 5.38% 01/02/2028	201.774	0,11
USD	275.000	CHS Community Health Systems Inc. 6.88% 15/04/2029	270.071	0,15	USD	614.000	CSC Holdings LLC 6.50% 01/02/2029	619.710	0,35
USD	305.000	CHS Community Health Systems Inc. 8.00% 15/03/2026	318.153	0,18	USD	256.000	DCP Midstream Operating LP 5.63% 15/07/2027	269.252	0,15
USD	457.000	Cinemark USA Inc. 5.25% 15/07/2028	427.631	0,24	USD	189.000	Delek Logistics Partners LP 6.75% 15/05/2025	189.701	0,11
USD	314.000	Cinemark USA Inc. 8.75% 01/05/2025	329.308	0,19	USD	324.000	Delta Air Lines Inc. 4.50% 20/10/2025	327.312	0,19
USD	343.000	Clarivate Science Holdings Corp. 3.88% 01/07/2028	327.351	0,19	USD	633.000	DirectTV Holdings LLC 5.88% 15/08/2027	624.915	0,35
USD	604.000	Clarivate Science Holdings Corp. 4.88% 01/07/2029	570.599	0,32	USD	938.000	DISH DBS Corp. 5.13% 01/06/2029	797.089	0,45
USD	386.000	Clear Channel Outdoor Holdings Inc. 7.50% 01/06/2029	386.108	0,22	USD	827.000	DISH DBS Corp. 5.75% 01/12/2028	786.355	0,45
USD	647.000	Clear Channel Worldwide 7.75% 15/04/2028	651.043	0,37	USD	332.000	DISH DBS Corp. 7.75% 01/07/2026	330.143	0,19
USD	638.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 5.13% 15/08/2027	632.418	0,36	USD	377.000	DT Midstream Inc. 4.13% 15/06/2029	361.911	0,21
USD	465.000	Clearway Energy Operating LLC 3.75% 15/02/2031	432.683	0,25	USD	668.000	Element Solutions Inc. 3.88% 01/09/2028	624.079	0,35
					USD	236.000	Endeavor Energy Resources LP 5.75% 30/01/2028	243.984	0,14
					USD	304.000	EQM Midstream Partner LP 4.50% 15/01/2029	285.397	0,16

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	742.000	EQM Midstream Partner LP 4.75% 15/01/2031	697.502	0,39	USD	342.000	Illuminate Buyer LLC 9.00% 01/07/2028	346.703	0,20
USD	270.000	EQM Midstream Partner LP 6.00% 01/07/2025	275.184	0,16	USD	286.000	Ingevity Corp. 3.88% 01/11/2028	258.830	0,15
USD	143.000	EQM Midstream Partner LP 6.50% 01/07/2027	149.727	0,09	USD	446.000	Innophos Holdings Inc. 9.38% 15/02/2028	476.244	0,27
USD	202.000	Gartner Inc. 3.63% 15/06/2029	191.245	0,11	USD	171.000	Interface Inc. 5.50% 01/12/2028	166.298	0,09
USD	373.000	Gartner Inc. 3.75% 01/10/2030	351.086	0,20	USD	603.000	Iqvia Inc. 5.00% 15/05/2027	611.147	0,35
USD	345.000	Gartner Inc. 4.50% 01/07/2028	343.887	0,20	USD	614.000	Irb Holding Corp. 6.75% 15/02/2026	626.391	0,36
USD	439.000	Gates Global LLC 6.25% 15/01/2026	441.296	0,25	USD	344.000	Irb Holding Corp. 7.00% 15/06/2025	359.528	0,20
USD	160.000	Goodyear Tire & Rubber Company 5.00% 15/07/2029	149.460	0,08	USD	219.000	Iris Holdings Inc. 8.75% 15/02/2026	219.274	0,12
USD	376.000	Group 1 Automotive Inc. 4.00% 15/08/2028	350.855	0,20	USD	215.000	Iron Mountain Inc. 4.88% 15/09/2027	212.984	0,12
USD	82.000	GTCR AP Finance Inc. 8.00% 15/05/2027	83.160	0,05	USD	237.000	Iron Mountain Inc. 5.00% 15/07/2028	231.653	0,13
USD	538.000	H&E Equipment Services Inc. 3.88% 15/12/2028	504.779	0,29	USD	299.000	Iron Mountain Inc. 5.25% 15/03/2028	296.197	0,17
USD	387.000	HealthEquity Inc. 4.50% 01/10/2029	369.101	0,21	USD	255.000	ITT Holdings LLC 6.50% 01/08/2029	235.948	0,13
USD	486.000	Helios Software Holdings Inc. 4.63% 01/05/2028	448.943	0,25	USD	798.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.50% 01/06/2031	721.810	0,42
USD	381.000	Herc Holdings Inc. 5.50% 15/07/2027	386.572	0,22	USD	1.019.000	Kar Auction Services Inc. 5.13% 01/06/2025	1.032.120	0,59
USD	127.000	Hess Midstream Operations LP 4.25% 15/02/2030	120.053	0,07	USD	200.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.25% 01/02/2027	191.900	0,11
USD	377.000	Hightower Holding LLC 6.75% 15/04/2029	370.629	0,21	USD	891.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 4.75% 15/06/2029	843.697	0,47
USD	197.000	Hilcorp Energy 6.25% 01/11/2028	200.097	0,11	USD	652.000	Ladder Capital Finance Holdings LLP 5.25% 01/10/2025	651.022	0,37
USD	373.000	Hilcorp Energy I 5.75% 01/02/2029	373.690	0,21	USD	373.000	Lamb Weston Holding Inc. 4.13% 31/01/2030	348.942	0,20
USD	113.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.38% 01/05/2025	115.850	0,07	USD	356.000	Lamb Weston Holdings Inc. 4.38% 31/01/2032	332.638	0,19
USD	125.000	Hilton Domestic Operating Company Inc. 5.75% 01/05/2028	129.544	0,07	USD	133.000	Leeward Renewable Energy Operations LLC 4.25% 01/07/2029	124.945	0,07
USD	372.000	Holly Energy Partners Corp. 5.00% 01/02/2028	353.741	0,20	USD	174.000	Live Nation Entertainment Inc. 3.75% 15/01/2028	164.187	0,09
USD	480.000	HUB International Limited 5.63% 01/12/2029	467.170	0,27	USD	367.000	Live Nation Entertainment Inc. 4.75% 15/10/2027	358.743	0,20
USD	633.000	HUB International Limited 7.00% 01/05/2026	642.302	0,36	USD	474.000	Live Nation Entertainment Inc. 6.50% 15/05/2027	505.735	0,29
USD	423.000	IAA Inc. 5.50% 15/06/2027	425.297	0,24	USD	813.000	LogMeIn Inc. 5.50% 01/09/2027	761.679	0,43
USD	391.000	iHeartCommunications 4.75% 15/01/2028	375.701	0,21	USD	317.000	Madison IAQ LLC 4.13% 30/06/2028	292.956	0,17
USD	212.000	iHeartCommunications Inc. 5.25% 15/08/2027	210.579	0,12	USD	597.000	Madison IAQ LLC 5.88% 30/06/2029	536.180	0,30
USD	689.757	iHeartCommunications Inc. 8.38% 01/05/2027	714.898	0,41					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	404.000	Matador Resources Company 5.88% 15/09/2026	411.828	0,23	USD	323.000	Novelis Corp. 3.88% 15/08/2031	296.390	0,17
USD	115.000	Match Group Holdings II LLC 3.63% 01/10/2031	103.500	0,06	USD	688.000	Novelis Corp. 4.75% 30/01/2030	671.889	0,38
USD	463.000	Match Group Holdings II LLC 4.63% 01/06/2028	449.675	0,26	USD	260.000	NRG Energy Inc. 3.38% 15/02/2029	231.400	0,13
USD	173.000	Mattel Inc. 5.88% 15/12/2027	181.104	0,10	USD	625.000	NRG Energy Inc. 3.63% 15/02/2031	553.437	0,30
USD	457.000	Mauser Packaging Solutions Holding Company 5.50% 15/04/2024	454.664	0,26	USD	193.000	NRG Energy Inc. 3.88% 15/02/2032	170.617	0,10
USD	600.000	Meritage Homes Corp. 3.88% 15/04/2029	572.625	0,33	USD	71.000	Occidental Petroleum Corp. 4.50% 15/07/2044	68.057	0,04
USD	485.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP 4.63% 15/06/2025	490.784	0,28	USD	85.000	Occidental Petroleum Corp. 6.20% 15/03/2040	94.964	0,05
USD	260.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP Mgp Finance Co-Issuer Inc. 5.75% 01/02/2027	274.871	0,16	USD	695.000	Occidental Petroleum Corp. 6.45% 15/09/2036	819.370	0,47
USD	89.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP MGP Finance Co-Issuer Inc. 3.88% 15/02/2029	88.032	0,05	USD	122.000	Occidental Petroleum Corp. 6.60% 15/03/2046	144.471	0,08
USD	214.000	Midwest Gaming Borrower LLC 4.88% 01/05/2029	197.980	0,11	USD	484.000	Olympus Water USA 4.25% 01/10/2028	441.444	0,25
USD	899.469	Mileage Plus Holdings LLC 6.50% 20/06/2027	939.196	0,53	USD	480.000	Organon & Company 4.13% 30/04/2028	457.620	0,26
USD	173.000	Mozart Debt Merger Sub Inc. 5.25% 01/10/2029	162.188	0,09	USD	533.000	Organon & Company 5.13% 30/04/2031	515.344	0,29
USD	175.000	NCR Corp 5.75% 01/09/2027	175.760	0,10	USD	558.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.25% 01/02/2028	575.818	0,33
USD	120.000	NCR Corp 6.13% 01/09/2029	120.525	0,07	USD	65.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc. 7.38% 01/06/2025	67.241	0,04
USD	651.000	NCR Corp. 5.00% 01/10/2028	623.576	0,35	USD	196.000	Outfront Media Capital LLC 4.25% 15/01/2029	182.574	0,10
USD	452.000	NextEra Energy Operating Partners 4.50% 15/09/2027	451.353	0,25	USD	211.000	Outfront Media Capital LLC 4.63% 15/03/2030	199.131	0,11
USD	153.000	NextEra Energy Operating Partners LP 4.25% 15/07/2024	155.133	0,09	USD	257.000	Par Pharmaceutical Inc. 7.50% 01/04/2027	240.650	0,14
USD	488.000	NFP Corp. 4.88% 15/08/2028	468.536	0,27	USD	273.000	Park Intermediate Holdings LLC 4.88% 15/05/2029	256.477	0,15
USD	1.038.000	NFP Corp. 6.88% 15/08/2028	992.588	0,56	USD	395.000	Park Intermediate Holdings LLC 5.88% 01/10/2028	395.273	0,22
USD	268.000	Nielsen Finance LLC 4.50% 15/07/2029	267.498	0,15	USD	474.000	PetSmart Inc. 4.75% 15/02/2028	459.297	0,26
USD	336.000	Nielsen Finance LLC 4.75% 15/07/2031	335.790	0,19	USD	166.000	PetSmart Inc. 7.75% 15/02/2029	171.603	0,10
USD	261.000	Nielsen Finance LLC 5.63% 01/10/2028	262.905	0,15	USD	796.000	Pilgrim's Pride Corp. 3.50% 01/03/2032	697.156	0,39
USD	327.000	Nielsen Finance LLC 5.88% 01/10/2030	328.989	0,19	USD	641.000	Pilgrim's Pride Corp. 4.25% 15/04/2031	594.254	0,34
USD	58.000	Northwest Fiber LLC 6.00% 15/02/2028	51.172	0,03	USD	1.012.000	Plantronics Inc. 4.75% 01/03/2029	1.040.915	0,59
USD	268.000	Novelis Corp. 3.25% 15/11/2026	256.392	0,15	USD	672.000	Post Holdings Inc. 4.63% 15/04/2030	606.479	0,34
					USD	230.000	Post Holdings Inc. 5.63% 15/01/2028	226.547	0,13
					USD	289.000	Post Holdings Inc. 5.75% 01/03/2027	290.987	0,17

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
USD	200.000 PRA Health Sciences Inc. 2.88% 15/07/2026	190.778	0,11	USD	259.000 Sirius XM Radio Inc. 4.00% 15/07/2028	246.077	0,14
USD	279.000 Prestige Brands Inc. 5.13% 15/01/2028	278.303	0,16	USD	174.000 Sirius XM Radio Inc. 5.50% 01/07/2029	176.828	0,10
USD	740.000 Provident Funding Associates LP 6.38% 15/06/2025	729.630	0,41	USD	400.000 Six Flags Entertainment Corp. 4.88% 31/07/2024	401.735	0,23
USD	446.000 Radiate Holco LLC 4.50% 15/09/2026	431.226	0,24	USD	268.000 Six Flags Theme Parks Inc. 7.00% 01/07/2025	280.369	0,16
USD	854.000 Radiate Holco LLC 6.50% 15/09/2028	810.233	0,46	USD	206.000 Southwestern Energy Company 5.38% 01/02/2029	209.454	0,12
USD	358.000 Resideo Funding Inc. 4.00% 01/09/2029	326.693	0,19	USD	238.000 SRS Distribution Inc. 4.63% 01/07/2028	227.460	0,13
USD	662.000 Ritchie Bros Holdings Inc. 4.75% 15/12/2031	646.277	0,36	USD	566.000 SRS Distribution Inc. 6.00% 01/12/2029	526.538	0,29
USD	230.000 RLJ Lodging Trust LP 3.75% 01/07/2026	218.608	0,12	USD	520.000 SRS Distribution Inc. 6.13% 01/07/2029	484.823	0,28
USD	219.000 RLJ Lodging Trust LP 4.00% 15/09/2029	203.057	0,12	USD	479.000 Staples Inc. 7.50% 15/04/2026	462.474	0,26
USD	626.000 Roblox Corp. 3.88% 01/05/2030	588.440	0,33	USD	188.000 Staples Inc. 10.75% 15/04/2027	167.790	0,10
USD	483.000 Rocket Mortgage LLC 3.63% 01/03/2029	442.871	0,25	USD	235.000 Stevens Holding Company Inc. 6.13% 01/10/2026	242.673	0,14
USD	299.000 Rocket Mortgage LLC 3.88% 01/03/2031	271.255	0,15	USD	442.000 Sunoco LP Sunoco Finance Corp. 5.88% 15/03/2028	450.248	0,26
USD	1.011.000 Rocket Mortgage LLC 4.00% 15/10/2033	890.666	0,51	USD	217.000 Surgery Center Holdings Inc. 6.75% 01/07/2025	216.908	0,12
USD	135.000 Ryan Specialty Group LLC 4.38% 01/02/2030	129.111	0,07	USD	90.000 Switch Limited 3.75% 15/09/2028	87.410	0,05
USD	137.000 Sabre Global Inc. 9.25% 15/04/2025	152.025	0,09	USD	492.000 Switch Limited 4.13% 15/06/2029	484.620	0,28
USD	301.000 Sabre Global Inc. 7.38% 01/09/2025	314.733	0,18	USD	332.000 Targa Resources Partners LP 5.50% 01/03/2030	345.625	0,20
USD	458.000 Scientific Games International Inc. 5.00% 15/10/2025	469.736	0,27	USD	88.000 Teleflex Inc. 4.25% 01/06/2028	86.216	0,05
USD	164.000 Scientific Games International Inc. 7.00% 15/05/2028	170.253	0,10	USD	136.000 Tempo Acquisition LLC 5.75% 01/06/2025	137.588	0,08
USD	166.000 Scientific Games International Inc. 7.25% 15/11/2029	174.117	0,10	USD	365.000 Tenet Healthcare Corp 4.88% 01/01/2026	370.056	0,21
USD	217.000 Scientific Games International Inc. 8.25% 15/03/2026	226.494	0,13	USD	505.000 Tenet Healthcare Corp 5.13% 01/11/2027	508.346	0,29
USD	676.000 Select Medical Corp. 6.25% 15/08/2026	700.248	0,39	USD	595.000 Tenet Healthcare Corp 6.25% 01/02/2027	611.853	0,35
USD	130.000 Service Properties Trust 5.50% 15/12/2027	125.563	0,07	USD	203.000 Tenet Healthcare Corp. 4.38% 15/01/2030	195.115	0,11
USD	173.000 Shea Homes LP Shea Homes Funding Corp. 4.75% 15/02/2028	164.226	0,09	USD	115.000 Tenet Healthcare Corp. 4.63% 15/06/2028	113.384	0,06
USD	362.000 Shift4 Payments LLC 4.63% 01/11/2026	352.498	0,20	USD	541.000 Tenet Healthcare Corp. 6.13% 01/10/2028	549.365	0,31
USD	235.000 Simmons Food Inc. 4.63% 01/03/2029	220.834	0,13	USD	748.000 Tenneco Inc. 7.88% 15/01/2029	788.672	0,44
				USD	179.000 Terraform Power Operating LLC 4.75% 15/01/2030	174.901	0,10
				USD	192.000 Terraform Power Operating LLC 5.00% 31/01/2028	191.880	0,11

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
USD	439.000 TK Elevator US Newco Inc. 5.25% 15/07/2027	436.631	0,24	USD	690.000 ZoomInfo Technologies LLC 3.88% 01/02/2029	631.988	0,36
USD	1.263.000 Transdigm Inc. 6.25% 15/03/2026	1.298.348	0,74	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			
USD	569.000 Transdigm Inc. 8.00% 15/12/2025	594.079	0,34	<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>111.152.746</b>	<b>63,10</b>
USD	619.000 Transmontaigne Partners LP 6.13% 15/02/2026	611.368	0,35	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
USD	1.387.000 Uber Technologies Inc. 4.50% 15/08/2029	1.301.180	0,73	<b>130.620.827</b>		<b>130.620.827</b>	<b>74,14</b>
USD	86.000 Uber Technologies Inc. 6.25% 15/01/2028	89.113	0,05	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
USD	482.000 United Airlines Inc. 4.38% 15/04/2026	473.866	0,27	<b>Anleihen</b>			
USD	279.000 Univision Communications Inc. 4.50% 01/05/2029	265.446	0,15	<b>BERMUDAS</b>			
USD	287.000 US Foods Inc. 4.63% 01/06/2030	265.588	0,15	USD	74.000 Ncl Corp. Limited 7.75% 15/02/2029	74.833	0,04
USD	498.000 US Foods Inc. 4.75% 15/02/2029	477.696	0,27	<b>Bermudas, insgesamt</b>			
USD	136.000 USA Compression Partners LP 6.88% 01/04/2026	137.345	0,08			<b>74.833</b>	<b>0,04</b>
USD	481.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 15/08/2029	468.374	0,27	<b>KANADA</b>			
USD	440.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 3.88% 01/11/2033	420.434	0,24	USD	324.000 Bausch Health Cos Inc. 6.13% 01/02/2027	326.229	0,19
USD	833.000 Venture Global Calcasieu Pass LLC 4.13% 15/08/2031	818.754	0,45	USD	365.000 Rockpoint Gas Storage 7.00% 31/03/2023	365.119	0,21
USD	452.000 Verscend Escrow Corp. 9.75% 15/08/2026	471.211	0,26	<b>Kanada, insgesamt</b>			
USD	509.000 Vici Properties 3.75% 15/02/2027	495.492	0,28			<b>691.348</b>	<b>0,40</b>
USD	449.000 Vistra Operations Company LLC 5.63% 15/02/2027	450.340	0,26	<b>LIBERIA</b>			
USD	801.000 Waste Pro USA Inc. 5.50% 15/02/2026	756.544	0,43	USD	179.000 Royal Caribbean Cruises Limited 5.38% 15/07/2027	171.361	0,10
USD	344.000 Wesco Distribution Inc. 7.13% 15/06/2025	358.190	0,20	<b>Liberia, insgesamt</b>			
USD	1.032.000 Wesco Distribution Inc. 7.25% 15/06/2028	1.098.254	0,63			<b>171.361</b>	<b>0,10</b>
USD	394.000 White Cap Buyer LLC 6.88% 15/10/2028	373.808	0,21	<b>LUXEMBURG</b>			
USD	567.000 WR Grace Holdings LLC 4.88% 15/06/2027	555.844	0,32	USD	327.000 Altice France Holding SA 10.50% 15/05/2027	342.802	0,19
USD	929.000 WR Grace Holdings LLC 5.63% 15/08/2029	869.437	0,49	<b>Luxemburg, insgesamt</b>			
USD	581.000 Zayo Group Holdings Inc. 4.00% 01/03/2027	535.380	0,30			<b>342.802</b>	<b>0,19</b>
USD	196.000 Zayo Group Holdings Inc. 6.13% 01/03/2028	175.485	0,10	<b>NIEDERLANDE</b>			
				USD	798.000 VZ Secured Financing BV Bond 5.00% 15/01/2032	746.465	0,42
				<b>Niederlande, insgesamt</b>			
						<b>746.465</b>	<b>0,42</b>
				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
				USD	806.000 CHS Community Health Systems Inc. 5.25% 15/05/2030	775.776	0,43

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
USD	582.000	Condor Merger Sub Inc. 7.38% 15/02/2030	558.257	0,32
USD	306.000	Covanta Holding Corp. 4.88% 01/12/2029	292.521	0,17
USD	472.000	Fair Isaac Corp. 4.00% 15/06/2028	456.817	0,26
USD	444.000	Fertitta Entertainment LLC 6.75% 15/01/2030	409.035	0,23
USD	20.000	Kaiser Aluminum Corp. 4.63% 01/03/2028	18.850	0,01
USD	690.000	Minerva Merger Sub Inc. 6.50% 15/02/2030	669.644	0,38
USD	309.000	Owens & Minor Inc. 6.63% 01/04/2030	318.168	0,18
USD	477.000	Scientific Games Holdings LP 6.63% 01/03/2030	470.203	0,27
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>3.969.271</b>	<b>2,25</b>
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>5.996.080</b>	<b>3,40</b>
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>5.996.080</b>	<b>3,40</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>166.681.017</b>	<b>94,65</b>
		<b>(Gesamtkosten: USD 171.526.270)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>BAHAMAS</b>				<b>KAIMANINSELN (Fortsetzung)</b>						
USD	200.000	Competition Team Technologies Limited 3.75% 12/03/2024	202.770	0,35	USD	450.000	Sunac China Holdings Limited 8.35% 19/04/2023	123.750	0,22	
		<b>Bahamas, insgesamt</b>	<b>202.770</b>	<b>0,35</b>	USD	400.000	Tencent Holdings Limited 2.88% 22/04/2031	367.117	0,64	
<b>BERMUDAS</b>				USD 300.000 Tencent Holdings Limited 3.98% 11/04/2029				299.854	0,52	
USD	200.000	China Oil & Gas Group Limited 5.50% 25/01/2023	201.675	0,35	USD	600.000	Times China Holdings Limited 6.75% 16/07/2023	306.720	0,53	
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>201.675</b>	<b>0,35</b>	USD	467.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp. 1.63% 24/09/2025	436.154	0,76	
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				<b>8.350.525</b>	<b>14,53</b>	
USD	250.000	AAC Technologies Holdings Inc. 3.00% 27/11/2024	237.185	0,42	<b>HONGKONG</b>					
USD	250.000	Alibaba Group Holding Limited 4.50% 28/11/2034	250.442	0,44	USD	400.000	Bank of East Asia Limited FRN 29/05/2030	397.512	0,69	
USD	500.000	China Mengniu Dairy Company 1.88% 17/06/2025	475.078	0,83	USD	200.000	GlP China Holdings 2.95% 29/03/2026	186.395	0,32	
USD	600.000	Cifi Holdings Group Company Limited 6.00% 16/07/2025	508.671	0,89	USD	500.000	Icbcil Finance Company 3.13% 15/11/2022	500.702	0,87	
USD	600.000	CK Hutchison International 17 II Limited 3.25% 29/09/2027	599.278	1,04	USD	950.000	Lenovo Group Limited 5.88% 24/04/2025	996.224	1,73	
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 3.13% 22/10/2025	147.950	0,26	USD	700.000	Xiaomi Best Time International Limited 2.88% 14/07/2031	606.558	1,06	
USD	200.000	Country Garden Holdings Company Limited 5.40% 27/05/2025	154.294	0,27	<b>Hongkong, insgesamt</b>				<b>2.687.391</b>	<b>4,67</b>
USD	500.000	ENN Energy Holdings Limited 2.63% 17/09/2030	449.061	0,78	<b>INDIEN</b>					
USD	600.000	Goodman HK Finance 3.00% 22/07/2030	573.872	1,00	USD	600.000	Adani Electricity Mumbai Limited 3.95% 12/02/2030	546.747	0,95	
USD	500.000	HPHT Finance 19 Limited 2.88% 05/11/2024	496.139	0,86	USD	280.000	Adani Green Energy Limited 4.38% 08/09/2024	275.369	0,48	
USD	500.000	JD.Com Inc. 3.38% 14/01/2030	472.357	0,82	USD	300.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 3.10% 02/02/2031	258.615	0,45	
USD	1.000.000	Logan Group Company Limited 4.70% 06/07/2026	209.625	0,36	USD	200.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.00% 30/07/2027	195.160	0,34	
USD	600.000	Longfor Properties Company 4.50% 16/01/2028	565.307	0,98	USD	400.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	385.758	0,67	
USD	800.000	Meituan 3.05% 28/10/2030	646.650	1,12	USD	800.000	Adani Transmission Limited 4.00% 03/08/2026	778.219	1,36	
USD	500.000	Melco Resorts Finance 4.88% 06/06/2025	461.908	0,80	USD	650.000	Bharti Airtel Limited 4.38% 10/06/2025	659.169	1,15	
USD	250.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 2.75% 13/05/2030	237.895	0,41	USD	226.000	GMR Hyderabad International Airport 4.75% 02/02/2026	217.525	0,38	
USD	270.000	Sun Hung Kai Properties Capital Market Limited 3.75% 25/02/2029	276.218	0,48	USD	500.000	Indian Railway Finance Corp. Limited 3.57% 21/01/2032	474.290	0,83	
USD	200.000	Sunac China Holdings Limited 6.50% 09/07/2023	55.000	0,10						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>INDIEN (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE</b>						
USD	200.000	JSW Steel Limited 5.95% 18/04/2024	205.064	0,36	USD	543.200	Greenko Dutch BV 3.85% 29/03/2026	517.715	0,90	
USD	500.000	Ongc Videsh Limited 4.63% 15/07/2024	512.007	0,89	USD	250.000	Mong Duong Finance Holdings BV 5.13% 07/05/2029	224.688	0,39	
USD	500.000	Reliance Industries Limited 3.67% 30/11/2027	498.809	0,87	USD	500.000	Royal Capital BV Perp FRN	499.605	0,87	
USD	800.000	ReNew Power Limited 6.45% 27/09/2022	804.217	1,41	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>1.242.008</b>	<b>2,16</b>	
USD	690.000	ReNew Wind Energy AP2 4.50% 14/07/2028	633.326	1,10	<b>PHILIPPINEN</b>					
<b>Indien, insgesamt</b>				<b>6.444.275</b>	<b>11,24</b>	USD	800.000	Globe Telecom Inc. 2.50% 23/07/2030	697.161	1,21
<b>INDONESIEN</b>						USD	520.000	Globe Telecom Inc. - Perp FRN	507.202	0,88
USD	1.400.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 6.76% 15/11/2048	1.562.945	2,72	USD	200.000	International Container Terminal Services Inc. 4.75% 17/06/2030	200.595	0,35	
USD	400.000	Pertamina Persero Pt 5.63% 20/05/2043	426.244	0,74	USD	714.000	Metropolitan Bank & Trust Company 2.13% 15/01/2026	683.428	1,19	
USD	1.000.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 5.25% 24/10/2042	1.013.780	1,77	USD	670.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	617.321	1,07	
USD	200.000	Perusahaan Listrik Negara Pt 6.25% 25/01/2049	226.513	0,39	USD	200.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	188.358	0,33	
USD	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT 4.00% 30/06/2050	178.095	0,31	USD	400.000	Smc Global Power Holdings Corp. Perp FRN	390.300	0,68	
USD	279.000	Saka Energi Indonesia Pt 4.45% 05/05/2024	274.610	0,48	<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>3.284.365</b>	<b>5,71</b>	
USD	400.000	Sri Rejeki Isman TBK PT 7.25% 16/01/2025	48.668	0,08	<b>SÜDKOREA</b>					
<b>Indonesien, insgesamt</b>				<b>3.730.855</b>	<b>6,49</b>	USD	500.000	Shinhan Financial Group Company Limited Perp FRN	511.272	0,89
<b>INSEL MAN</b>						USD	500.000	Sk Hynix Inc. 1.50% 19/01/2026	463.587	0,81
USD	400.000	Gohl Capital Limited 4.25% 24/01/2027	379.353	0,66	<b>Südkorea, insgesamt</b>			<b>974.859</b>	<b>1,70</b>	
<b>Insel Man, insgesamt</b>				<b>379.353</b>	<b>0,66</b>	<b>SINGAPUR</b>				
<b>MALAYSIA</b>						USD	500.000	ABJA Investment Company 5.45% 24/01/2028	517.528	0,90
USD	200.000	Axiata Bhd 4.36% 24/03/2026	207.798	0,36	USD	400.000	BOC Aviation Limited 2.63% 17/09/2030	360.994	0,63	
USD	500.000	Petronas Capital Limited 3.50% 21/04/2030	509.963	0,89	USD	550.000	DBS Group Holdings Limited FRN 11/12/2028	561.443	0,98	
USD	400.000	TNB Global Ventures Capital Bhd 4.85% 01/11/2028	424.885	0,74	USD	700.000	SingTel Group Treasury Pte Limited 1.88% 10/06/2030	637.853	1,11	
<b>Malaysia, insgesamt</b>				<b>1.142.646</b>	<b>1,99</b>	USD	550.000	United Overseas Bank LT FRN 16/03/2031	511.397	0,89
<b>MAURITIUS</b>						<b>Singapur, insgesamt</b>			<b>2.589.215</b>	<b>4,51</b>
USD	400.000	Greenko Solar Mauritius Limited 5.55% 29/01/2025	403.541	0,70	<b>THAILAND</b>					
<b>Mauritius, insgesamt</b>				<b>403.541</b>	<b>0,70</b>	USD	800.000	Bangkok Bank pcl FRN 25/09/2034	748.503	1,30

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*					
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>								
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>								
<b>THAILAND (Fortsetzung)</b>				<b>CHINA</b>								
USD	200.000	GC Treasury Centre Company 2.98% 18/03/2031	183.324	0,32	USD	606.000	China (Govt of) 1.95% 03/12/2024	598.004	1,04			
USD	400.000	Kasikornbank plc FRN 02/10/2031	377.231	0,66								
		<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>1.309.058</b>	<b>2,28</b>			<b>China, insgesamt</b>	<b>598.004</b>	<b>1,04</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>INDIEN</b>								
USD	1.000.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	1.013.742	1,77	USD	400.000	Export-Import Bank of India 3.25% 15/01/2030	377.942	0,66			
USD	600.000	Standard Chartered plc Perp FRN	620.740	1,08			<b>Indien, insgesamt</b>	<b>377.942</b>	<b>0,66</b>			
USD	400.000	Vedanta Resources plc 6.13% 09/08/2024	347.226	0,60								
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>1.981.708</b>	<b>3,45</b>			<b>INDONESIEN</b>					
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				<b>INDONESIEN</b>								
USD	500.000	CMHI Finance BVI Company Perp FRN	502.476	0,87	USD	800.000	Indonesia (Govt of) 3.40% 18/09/2029	820.566	1,43			
USD	500.000	CNPC Global Capital Limited 1.35% 23/06/2025	471.923	0,82	USD	1.000.000	Indonesia (Govt of) 4.75% 11/02/2029	1.107.411	1,92			
USD	650.000	Contemporary Ruiding Development Limited 2.63% 17/09/2030	576.435	1,00	USD	200.000	Indonesia (Govt of) 6.63% 17/02/2037	251.434	0,44			
USD	800.000	Elect Global Investments Limited Perp FRN	774.534	1,35	USD	300.000	Indonesia (Govt of) 7.75% 17/01/2038	411.787	0,72			
USD	750.000	FPC Resources Limited 4.38% 11/09/2027	753.459	1,31	USD	200.000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 2.30% 23/06/2025	198.393	0,35			
USD	511.000	HKT Capital No 5 Limited 3.25% 30/09/2029	491.390	0,86			<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>2.789.591</b>	<b>4,86</b>			
USD	500.000	Hongkong Electric Finance Limited 1.88% 27/08/2030	439.568	0,77			<b>PAKISTAN</b>					
USD	1.439.000	Jgsh Philippines Limited 4.13% 09/07/2030	1.406.353	2,45	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.00% 08/04/2026	269.351	0,47			
USD	600.000	Nan Fung Treasury Limited 5.00% 05/09/2028	610.473	1,06	USD	350.000	Pakistan (Govt of) 6.88% 05/12/2027	275.650	0,48			
USD	750.000	State Grid Overseas Investment BVI Limited 1.63% 05/08/2030	654.916	1,14	USD	200.000	Pakistan (Govt of) 8.25% 30/09/2025	163.795	0,29			
USD	500.000	Studio City Finance Limited 5.00% 15/01/2029	383.734	0,67			<b>Pakistan, insgesamt</b>	<b>708.796</b>	<b>1,24</b>			
USD	700.000	Studio City Finance Limited 6.00% 15/07/2025	644.475	1,12			<b>PHILIPPINEN</b>					
USD	850.000	Tsmc Global Limited 0.75% 28/09/2025	785.560	1,36	USD	1.000.000	Philippine (Govt of) 3.00% 01/02/2028	1.005.993	1,75			
USD	400.000	Yongda Investment Limited 2.25% 16/06/2025	383.166	0,67	USD	900.000	Philippine (Govt of) 3.75% 14/01/2029	938.486	1,63			
		<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>	<b>8.878.462</b>	<b>15,45</b>			<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>1.944.479</b>	<b>3,38</b>			
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>43.802.706</b>	<b>76,24</b>			<b>SRI LANKA</b>				
								USD	540.000	Sri Lanka (Govt of) 7.55% 28/03/2030	259.704	0,45
										<b>Sri Lanka, insgesamt</b>	<b>259.704</b>	<b>0,45</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>			
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>			
USD	700.000 Talent Yield International Limited 3.13% 06/05/2031	665.401	1,16
	<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>	<b>665.401</b>	<b>1,16</b>
	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>7.343.917</b>	<b>12,79</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>51.146.623</b>	<b>89,03</b>

**Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere**

**Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente**

<b>CHINA</b>			
CNY	6.000.000 China (Govt of) 2.36% 02/07/2023	947.451	1,65
CNY	10.000.000 China (Govt of) 2.85% 04/06/2027	1.594.710	2,77
CNY	7.000.000 China (Govt of) 3.12% 05/12/2026	1.130.375	1,96
	<b>China, insgesamt</b>	<b>3.672.536</b>	<b>6,38</b>
	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>3.672.536</b>	<b>6,38</b>
	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>3.672.536</b>	<b>6,38</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>54.819.159</b>	<b>95,41</b>

(Gesamtkosten: USD 59.796.370)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert		Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren (Fortsetzung)</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>					<b>Fonds (Fortsetzung)</b>						
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>LUXEMBURG</b>						
GBP	575.000	United Kingdom Gilt 1.25% 22/07/2027	674.933	2,00	128.249	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities XU**	2.648.205	7,86			
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>674.933</b>	<b>2,00</b>	236.347	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond 4E**	2.469.877	7,33			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>74.915</b> Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**					714.888	2,12
<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe</b>					<b>305.372</b> Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities XE**					3.233.732	9,59
<b>IRLAND</b>					<b>121.975</b> Threadneedle Lux - European High Yield Bond 4E**					1.357.249	4,03
	61	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	10.305	0,03	140.933	Threadneedle Lux - Global Focus XU**	3.141.191	9,32			
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.305</b>	<b>0,03</b>	88.703	Threadneedle Lux - Pan European Smaller Companies 4E**	1.082.041	3,21			
<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt</b>					<b>33.181</b> Threadneedle Lux-European Short Term High Yield Bond XE**					3.471.871	10,29
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>					<b>Luxemburg, insgesamt</b>					<b>18.119.054</b>	<b>53,75</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					<b>Fonds, insgesamt</b>					<b>19.361.197</b>	<b>57,44</b>
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>					<b>19.361.197</b>	<b>57,44</b>
<b>FRANKREICH</b>					<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen</b>						
EUR	3.000.000	France (Govt of) 0.00% 24/08/2022	3.007.272	8,93	<b>Fonds</b>						
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>3.007.272</b>	<b>8,93</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>						
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>GBP</b> 144.724 Threadneedle European Select Fund X***					337.277	1,00
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>					<b>EUR</b> 67.108 Threadneedle Investment Funds ICVC - American Fund***					532.633	1,58
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>					<b>GBP</b> 522.117 Threadneedle Investment Funds ICVC - Asia Fund***					1.346.409	4,00
<b>Fonds</b>					<b>GBP</b> 154.866 Threadneedle Investment Funds ICVC - European Fund***					351.531	1,04
<b>IRLAND</b>					<b>GBP</b> 1.011.972 Threadneedle Investment Funds ICVC - Japan Fund***					2.358.024	7,00
	12.646	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	1.242.143	3,69	<b>EUR</b> 339.911 Threadneedle Specialist Investment Funds Icvc - Emerging Market Local Fund***					854.604	2,54
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.242.143</b>	<b>3,69</b>							

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen (Fortsetzung)</b>				
<b>Fonds (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
GBP	1.548.159	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Sterling Short-Dated Corporate Bond Fund***	2.064.673	6,13
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>7.845.151</b>	<b>23,29</b>
		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>7.845.151</b>	<b>23,29</b>
		<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt</b>	<b>7.845.151</b>	<b>23,29</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>30.898.858</b>	<b>91,69</b>
		<b>(Gesamtkosten: EUR 27.284.779)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Siehe Erläuterung 18.

\*\*\*Fonds der verbundenen Partei.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>INDONESIEN</b>					
USD	3.000.000	United States Treasury N/B 0.13% 31/01/2023	2.964.609	6,62	1.359.250	Bank Rakyat Indonesia	441.044	0,98	
			<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>2.964.609</b>	<b>6,62</b>	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>441.044</b>	<b>0,98</b>	
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>2.964.609</b>	<b>6,62</b>	<b>IRLAND</b>			
<b>Aktien</b>				<b>JAPAN</b>					
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
1.683	Sea Limited	201.607	0,45	900	Keyence Corp.	424.511	0,94		
			<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>201.607</b>	<b>0,45</b>	5.500	Recruit Holdings Company Limited	245.331	0,55
<b>DÄNEMARK</b>				<b>Japan, insgesamt</b>					
4.934	Novo Nordisk A/S	552.712	1,23	3.200	Sony Corp.	335.621	0,75		
3.521	Orsted A/S	447.252	0,99	4.600	Yaskawa Electric Corp.	182.484	0,41		
11.886	Tryg A/S	292.024	0,65	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>481.395</b>	<b>1,07</b>	
			<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>1.291.988</b>	<b>2,87</b>	<b>NORWEGEN</b>			
<b>FINNLAND</b>				<b>SÜDKOREA</b>					
6.895	Upm-Kymmene Oyj	227.543	0,51	1.510	Airbus SE	185.416	0,41		
			<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>227.543</b>	<b>0,51</b>	1.637	Koninklijke DSM NV	295.979	0,66
<b>FRANKREICH</b>				<b>Niederlande, insgesamt</b>					
2.323	Essilor International SA	429.833	0,96	<b>NORWEGEN</b>					
3.782	Schneider Electric SE	640.296	1,43	10.665	Equinor ASA	403.962	0,90		
			<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>1.070.129</b>	<b>2,39</b>	<b>Norwegen, insgesamt</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SÜDKOREA</b>					
1.168	Adidas AG	275.380	0,61	14.000	Samsung Electronics Company Limited	803.929	1,79		
			<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>275.380</b>	<b>0,61</b>	634	Samsung Sdi Company Limited	311.757	0,70
<b>HONGKONG</b>				<b>SÜDKOREA, insgesamt</b>					
21.600	AIA Group Limited	227.407	0,51	<b>Südkorea, insgesamt</b>			<b>1.115.686</b>	<b>2,49</b>	
			<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>227.407</b>	<b>0,51</b>	<b>SCHWEIZ</b>			
<b>INDIEN</b>				<b>TAIWAN</b>					
6.587	HDFC Bank Limited - ADR	403.981	0,90	43.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	895.968	2,00		
			<b>Indien, insgesamt</b>	<b>403.981</b>	<b>0,90</b>	<b>Schweiz, insgesamt</b>			
				<b>Taiwan, insgesamt</b>					
				<b>895.968</b>				<b>2,00</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>IRLAND</b>			
7.569	Diageo plc	385.026	0,86	8.169	Invesco Physical Gold ETC		
13.734	SSE PLC	316.179	0,71		0.00%	1.535.445	3,43
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>701.205</b>	<b>1,57</b>		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>1.535.445</b>	<b>3,43</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt</b>			
2.682	Abbott Laboratories	317.442	0,71				
1.325	Adobe Systems Inc.	603.696	1,35				
623	Alphabet Inc. - A	1.732.781	3,87				
461	Amazon.com Inc.	1.502.837	3,36				
1.317	American Tower Corp.	330.857	0,74				
1.702	Autodesk Inc.	364.824	0,81				
5.155	Centene Corp.	433.999	0,97				
892	Cooper Companies Inc.	372.490	0,83				
1.436	Deere & Company	596.601	1,33				
2.539	Doximity Inc.	132.257	0,30				
1.677	Ecolab Inc.	296.091	0,66				
3.193	Electronic Arts Inc.	403.946	0,90				
1.473	Eli Lilly & Company	421.823	0,94				
410	Equinix Inc.	304.064	0,68				
1.864	Fidelity National Information Services Inc.	187.183	0,42				
7.429	General Motors Company	324.944	0,72				
1.569	IntercontinentalExchange Inc.	207.296	0,46				
1.242	Intuit Inc.	597.203	1,33				
4.206	JPMorgan Chase & Company	573.361	1,28				
927	Lam Research Corp.	498.364	1,11				
2.517	Mastercard Inc. - A	899.526	2,00				
239	Mercadolibre Inc.	284.286	0,63				
6.302	Microsoft Corp.	1.942.969	4,33				
3.692	NextEra Energy Inc.	312.749	0,70				
2.181	Nvidia Corp.	595.108	1,33				
2.439	Paypal Holdings Inc.	282.070	0,63				
3.399	Qualcomm Inc.	519.435	1,16				
553	S&P Global Inc.	226.830	0,51				
1.642	Stryker Corp.	438.989	0,98				
829	Thermo Fisher Scientific Inc.	489.649	1,09				
5.531	T-Mobile USA Inc.	709.904	1,58				
2.551	Transunion	263.620	0,59				
3.213	Trimble Navigation Limited	231.786	0,52				
8.061	Uber Technologies Inc.	287.616	0,64				
1.594	Union Pacific Corp.	435.497	0,97				
3.748	Walt Disney Company	514.076	1,15				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>18.636.169</b>	<b>41,58</b>				
<b>Aktien, insgesamt</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
		<b>29.907.046</b>	<b>66,71</b>			<b>34.407.100</b>	<b>76,76</b>
				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
	USD	2.500.000	United States Treasury Bill				
			0.00% 23/06/2022			2.497.295	5,57
						<b>2.497.295</b>	<b>5,57</b>
				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>			
				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>			
				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
				<b>Fonds</b>			
				<b>LUXEMBURG</b>			
				158.873	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio XU**	3.650.129	8,14
				6.432	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XU**	68.290	0,15
				539	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond XE**	62.775	0,14
					<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>3.781.194</b>	<b>8,43</b>
				<b>Fonds, insgesamt</b>			
				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
				<b>3.781.194</b>			
				<b>8,43</b>			

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen</b>				
<b>Fonds</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
USD	45.881	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund***	127.994	0,29
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>127.994</b>	<b>0,29</b>
		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>127.994</b>	<b>0,29</b>
		<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt</b>	<b>127.994</b>	<b>0,29</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>40.813.583</b>	<b>91,05</b>
		<b>(Gesamtkosten: USD 32.071.345)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Siehe Erläuterung 18.

\*\*\*Fonds der verbundenen Partei.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>FINNLAND (Fortsetzung)</b>						
EUR	100.000	APT Pipelines Limited 0.75% 15/03/2029	101.085	0,07	EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 2.63% 31/03/2027	110.639	0,08	
USD	77.000	Ausgrid Finance Pty Limited 4.35% 01/08/2028	78.681	0,06	<b>Finnland, insgesamt</b>			<b>423.164</b>	<b>0,30</b>	
<b>Australien, insgesamt</b>				<b>179.766</b>	<b>0,13</b>	<b>FRANKREICH</b>				
<b>BELGIEN</b>				EUR 100.000 Altice France SA 2.50% 15/01/2025				107.269	0,08	
EUR	100.000	Solvay SA Perp FRN	104.697	0,07	EUR	100.000	Altice France SA 4.00% 15/07/2029	100.408	0,07	
EUR	200.000	Solvay SA Perp FRN	226.761	0,17	EUR	100.000	Altice France SA 4.13% 15/01/2029	101.231	0,07	
<b>Belgien, insgesamt</b>				<b>331.458</b>	<b>0,24</b>	EUR	104.000	Altice France SA 4.25% 15/10/2029	105.281	0,07
<b>BERMUDAS</b>				EUR 100.000 Altice France SA 5.88% 01/02/2027				114.116	0,08	
USD	100.000	Bacardi Limited 5.30% 15/05/2048	112.117	0,08	EUR	100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	102.790	0,07	
<b>Bermudas, insgesamt</b>				<b>112.117</b>	<b>0,08</b>	EUR	100.000	BPCE SA 0.25% 14/01/2031	98.322	0,07
<b>KANADA</b>				EUR 192.000 CAB Selas 3.38% 01/02/2028				203.653	0,14	
USD	29.000	Canadian Pacific Railway Company 3.10% 02/12/2051	25.789	0,02	EUR	100.000	Casino Guichard Perrachon SA 5.25% 15/04/2027	95.173	0,07	
EUR	172.000	Primo Water Holdings Inc. 3.88% 31/10/2028	178.722	0,13	EUR	107.000	Casino Guichard Perrachon SA 6.63% 15/01/2026	108.822	0,08	
USD	10.000	Rogers Communications Inc. 3.70% 15/11/2049	9.028	0,01	EUR	200.000	Casino Guichard-Perrachon SA 4.50% 07/03/2024	208.408	0,15	
<b>Kanada, insgesamt</b>				<b>213.539</b>	<b>0,16</b>	EUR	100.000	Chrome Holding SASU 5.00% 31/05/2029	103.732	0,07
<b>KAIMANINSELN</b>				EUR 139.000 CMA CGM SA 7.50% 15/01/2026				167.499	0,12	
GBP	212.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028	272.859	0,19	EUR	214.000	Constellium SE 3.13% 15/07/2029	219.330	0,15	
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				<b>272.859</b>	<b>0,19</b>	EUR	100.000	Credit Agricole SA FRN 21/09/2029	102.246	0,07
<b>DÄNEMARK</b>				EUR 100.000 Crown European Holdings SA 2.88% 01/02/2026				113.019	0,08	
EUR	100.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025	109.633	0,08	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	199.900	0,14	
<b>Dänemark, insgesamt</b>				<b>109.633</b>	<b>0,08</b>	EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	207.545	0,15
<b>FINNLAND</b>				EUR 200.000 Electricite de France SA Perp FRN				228.173	0,16	
EUR	100.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	107.191	0,08	EUR	100.000	Electricite de France SA Perp FRN	115.812	0,08	
EUR	100.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	103.201	0,07	GBP	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	261.114	0,19	
EUR	100.000	Teollisuuden Voima Oyj 1.38% 23/06/2028	102.133	0,07	EUR	100.000	Elior Group SA 3.75% 15/07/2026	101.764	0,07	
				EUR 100.000 Elis SA 1.00% 03/04/2025				107.820	0,08	
				EUR 100.000 Emeria SASU 3.38% 31/03/2028				104.995	0,07	
				EUR 400.000 Faurecia SE 2.38% 15/06/2027				398.266	0,27	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>FRANKREICH (Fortsetzung)</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>					
EUR	187.000	Faurecia SE 2.75% 15/02/2027	190.677	0,13	EUR	89.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	95.396	0,07
EUR	100.000	Faurecia SE 3.75% 15/06/2028	104.847	0,07	EUR	100.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	114.028	0,08
EUR	205.000	Getlink SE 3.50% 30/10/2025	233.663	0,16	EUR	66.000	Deutsche Bank AG FRN 10/06/2026	73.956	0,05
EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	105.287	0,07	USD	150.000	Deutsche Bank AG FRN 28/05/2032	134.870	0,09
EUR	317.000	Iliad Holding SASU 5.13% 15/10/2026	357.602	0,26	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 11/02/2025	109.548	0,08
EUR	100.000	Iliad Holding SASU 5.63% 15/10/2028	111.292	0,08	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	207.387	0,15
EUR	100.000	Iqera Group SAS 6.50% 30/09/2024	111.982	0,08	EUR	200.000	Deutsche Lufthansa AG 3.00% 29/05/2026	214.754	0,14
EUR	100.000	La Financiere Atalian SASU 5.13% 15/05/2025	101.271	0,07	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.50% 14/07/2029	102.960	0,07
EUR	182.000	Loxam SAS 3.25% 14/01/2025	199.781	0,14	EUR	100.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	107.350	0,08
EUR	100.000	Loxam SAS 5.75% 15/07/2027	108.868	0,08	EUR	100.000	Douglas GmbH 6.00% 08/04/2026	106.180	0,07
EUR	100.000	Orano SA 3.38% 23/04/2026	114.494	0,08	EUR	111.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	120.419	0,08
EUR	100.000	Paprec Holding SA 3.50% 01/07/2028	106.281	0,07	EUR	100.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	108.485	0,08
EUR	160.000	Paprec Holding SA 4.00% 31/03/2025	179.584	0,13	EUR	210.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	234.051	0,16
EUR	163.000	Parts Europe SA 6.50% 16/07/2025	187.541	0,14	EUR	100.000	Infineon Technologies AG Perp FRN	111.634	0,08
EUR	117.000	Picard Groupe SAS 3.88% 01/07/2026	126.724	0,09	EUR	200.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	189.990	0,13
EUR	200.000	Renault SA 2.38% 25/05/2026	210.202	0,15	EUR	150.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 3.50% 30/09/2024	160.510	0,11
EUR	100.000	Renault SA 2.50% 02/06/2027	102.727	0,07	EUR	215.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	228.189	0,17
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/06/2028	106.629	0,07	EUR	226.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	242.472	0,17
EUR	100.000	Rexel SA 2.13% 15/12/2028	105.355	0,07	EUR	191.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	210.735	0,15
EUR	100.000	Spie SA 3.13% 22/03/2024	114.337	0,08	EUR	100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	111.928	0,08
EUR	200.000	Valeo 1.00% 03/08/2028	194.642	0,14	EUR	150.000	Schaeffler AG 2.88% 26/03/2027	164.671	0,12
EUR	100.000	Veolia Environnement SA Perp FRN	108.514	0,08	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	109.187	0,08
EUR	200.000	Verallia SA 1.63% 14/05/2028	207.951	0,15	EUR	100.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	109.187	0,08
EUR	100.000	Verallia SA 1.88% 10/11/2031	98.380	0,07	EUR	150.000	Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	165.579	0,11
		<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>7.365.319</b>	<b>5,18</b>	EUR	329.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	352.780	0,24
<b>DEUTSCHLAND</b>					EUR	100.000	Tele Columbus AG 3.88% 02/05/2025	103.681	0,07
EUR	100.000	Adler Real Estate AG 1.88% 27/04/2023	105.789	0,07	EUR	94.000	thyssenkrupp AG 2.50% 25/02/2025	104.339	0,07
EUR	100.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	93.611	0,07					
EUR	100.000	Bayer AG 1.13% 06/01/2030	104.304	0,07					
EUR	200.000	Bayer AG FRN 25/03/2082	224.973	0,16					
EUR	130.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 3.50% 11/02/2027	140.677	0,10					
EUR	101.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 4.38% 15/01/2028	111.262	0,08					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>			
EUR	110.000 Thyssenkrupp AG 2.88% 22/02/2024	122.194	0,09	EUR	100.000 IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3.75% 15/01/2028	104.518	0,07
EUR	100.000 TK Elevator Midco GmbH 4.38% 15/07/2027	110.127	0,08	EUR	174.000 International Design Group SPA 6.50% 15/11/2025	195.601	0,13
EUR	19.000 Volkswagen Financial Services AG 3.38% 06/04/2028	22.620	0,02	EUR	100.000 Intesa Sanpaolo SpA FRN 12/07/2029	116.139	0,08
EUR	100.000 ZF Finance GmbH 3.75% 21/09/2028	105.955	0,07	EUR	107.000 Leonardo SpA 2.38% 08/01/2026	120.488	0,08
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>5.235.778</b>	<b>3,67</b>	EUR	111.000 Marcolin SpA 6.13% 15/11/2026	120.312	0,08
				EUR	293.000 Nexi SpA 1.63% 30/04/2026	311.218	0,22
				EUR	120.000 Telecom Italia SpA 2.75% 15/04/2025	131.306	0,09
<b>IRLAND</b>				EUR	150.000 Telecom Italia SpA 3.63% 25/05/2026	166.772	0,12
EUR	100.000 AIB Group plc FRN 19/11/2029	108.820	0,08	EUR	146.000 Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	166.850	0,12
EUR	101.000 Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	103.206	0,07	EUR	100.000 Unipol Gruppo SpA 3.25% 23/09/2030	114.181	0,08
EUR	276.000 Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	303.291	0,21		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>3.454.213</b>	<b>2,42</b>
EUR	100.000 Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	109.378	0,08				
GBP	185.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III 4.88% 15/07/2028	230.428	0,16	<b>JAPAN</b>			
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>855.123</b>	<b>0,60</b>	USD	200.000 Central Nippon Expressway Company Limited 0.89% 10/12/2025	184.886	0,13
				USD	200.000 Japan Finance Organization for Municipalities 0.63% 02/09/2025	185.272	0,13
<b>INSEL MAN</b>				EUR	100.000 Softbank Group Corp. 2.88% 06/01/2027	99.478	0,07
EUR	142.000 Playtech plc 4.25% 07/03/2026	158.801	0,11	EUR	100.000 Softbank Group Corp. 3.13% 19/09/2025	104.698	0,07
	<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>158.801</b>	<b>0,11</b>	EUR	100.000 Softbank Group Corp. 4.00% 19/09/2029	97.381	0,07
					<b>Japan, insgesamt</b>	<b>671.715</b>	<b>0,47</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>			
EUR	113.000 Atlantia SpA 1.88% 13/07/2027	120.185	0,08	EUR	100.000 Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	109.497	0,08
EUR	124.000 Atlantia SpA 1.88% 12/02/2028	130.760	0,09	EUR	259.000 Avis Budget Finance plc 4.75% 30/01/2026	290.217	0,20
EUR	206.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.63% 25/01/2028	220.294	0,15	EUR	100.000 Kane Bidco Limited 5.00% 15/02/2027	108.980	0,08
EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.75% 01/02/2027	108.644	0,08		<b>Jersey - Kanalseln, insgesamt</b>	<b>508.694</b>	<b>0,36</b>
EUR	100.000 Autostrade per l'Italia SpA 1.88% 04/11/2025	110.323	0,08	<b>LUXEMBURG</b>			
EUR	300.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	324.967	0,23	EUR	200.000 Adler Group SA 2.75% 13/11/2026	186.904	0,13
EUR	200.000 Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 15/01/2030	210.146	0,15				
EUR	199.000 Autostrade per l'Italia SpA 4.38% 16/09/2025	238.735	0,17				
EUR	170.000 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	172.209	0,13				
EUR	100.000 Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	112.646	0,08				
EUR	149.000 Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	157.919	0,11				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>				<b>MEXIKO</b>			
EUR	200.000 Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	196.688	0,14	EUR	100.000 Petroleos Mexicanos 2.75% 21/04/2027	98.753	0,07
EUR	130.000 Altice Financing SA 2.25% 15/01/2025	138.258	0,10	EUR	137.000 Petroleos Mexicanos 3.75% 21/02/2024	153.031	0,11
EUR	100.000 Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	99.621	0,07	EUR	149.000 Petroleos Mexicanos 4.75% 26/02/2029	153.997	0,11
EUR	137.000 Altice Finco SA 4.75% 15/01/2028	134.039	0,09	EUR	140.000 Petroleos Mexicanos 4.88% 21/02/2028	148.571	0,10
EUR	264.000 Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	303.767	0,21	USD	50.000 Petroleos Mexicanos 6.88% 04/08/2026	52.404	0,04
GBP	120.000 Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	151.924	0,11		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>606.756</b>	<b>0,43</b>
GBP	140.000 B&m European Value Retail SA 3.63% 15/07/2025	180.786	0,13				
GBP	100.000 B&m European Value Retail SA 4.00% 15/11/2028	123.809	0,09		<b>NIEDERLANDE</b>		
EUR	100.000 Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	91.692	0,06	EUR	137.000 Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	141.023	0,10
EUR	141.000 Canpack SA 2.38% 01/11/2027	144.793	0,10	EUR	100.000 Cooperatieve Rabobank UA 1.38% 03/02/2027	112.922	0,08
EUR	121.000 Cirsa Finance International Sarl 4.75% 22/05/2025	132.195	0,09	EUR	200.000 Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	224.477	0,15
EUR	180.024 Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	201.590	0,14	EUR	100.000 Digital Intrepid Holding BV 1.38% 18/07/2032	97.880	0,07
GBP	100.000 Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	131.071	0,09	EUR	100.000 Dufry One BV 3.38% 15/04/2028	103.407	0,07
EUR	150.000 Hanesbrands Inc. 3.50% 15/06/2024	171.073	0,12	GBP	68.000 E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	111.541	0,08
EUR	123.000 Holcim Finance Luxembourg SA Perp FRN	137.360	0,10	EUR	100.000 Enexis Holding NV 0.75% 02/07/2031	103.695	0,07
EUR	100.000 HSE Finance Sarl 5.63% 15/10/2026	105.681	0,07	EUR	100.000 ING Groep NV FRN 16/02/2031	109.417	0,08
EUR	284.000 InPost SA 2.25% 15/07/2027	290.877	0,21	EUR	128.000 Intertrust Group BV 3.38% 15/11/2025	142.513	0,10
EUR	100.000 Intralot Capital Lux 5.25% 15/09/2024	93.463	0,07	EUR	100.000 Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	115.425	0,08
EUR	198.000 Lincoln Financing SARL 3.63% 01/04/2024	220.651	0,15	EUR	151.000 Nobel Bidco BV 3.13% 15/06/2028	150.069	0,11
EUR	100.000 Matterhorn Telecom SA 4.00% 15/11/2027	108.932	0,08	EUR	90.000 Oci NV 3.63% 15/10/2025	101.883	0,07
EUR	100.000 P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	101.983	0,07	EUR	167.000 PPF Telecom Group BV 3.25% 29/09/2027	182.107	0,13
EUR	100.000 Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	109.369	0,08	EUR	174.000 Repsol International Finance BV FRN 25/03/2075	201.806	0,14
EUR	44.000 Telecom Italia Finance SA 7.75% 24/01/2033	56.437	0,04	EUR	224.000 Repsol International Finance BV Perp FRN	236.680	0,17
EUR	100.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 3.50% 01/03/2028	108.990	0,08	EUR	100.000 Repsol International Finance BV Perp FRN	112.385	0,08
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>3.721.953</b>	<b>2,62</b>	EUR	100.000 Repsol International Finance BV Perp FRN	112.020	0,08
				EUR	100.000 Stedin Holding NV Perp FRN	107.296	0,08
				EUR	131.619 Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	146.204	0,10

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Nettoinventarwerts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>						
<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>				<b>PORTUGAL (Fortsetzung)</b>						
EUR	118.083	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	131.168	0,09	EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 30/04/2079	115.772	0,08	
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	104.415	0,07	<b>Portugal, insgesamt</b>					
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	103.041	0,07	<b>216.308</b>					
EUR	200.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	206.082	0,14	<b>0,15</b>					
EUR	500.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	577.210	0,41	<b>RUMÄNIEN</b>					
EUR	100.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	118.335	0,08	EUR	100.000	RCS & RDS SA 2.50% 05/02/2025	106.993	0,08	
EUR	287.000	Tennet Holding BV Perp FRN	320.616	0,23	<b>Rumänien, insgesamt</b>					
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 3.75% 09/05/2027	105.452	0,07	<b>106.993</b>					
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.38% 09/05/2030	103.589	0,07	<b>0,08</b>					
EUR	100.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 4.50% 01/03/2025	112.366	0,08	<b>SPANIEN</b>					
EUR	100.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	100.262	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company 2.00% 15/02/2033	95.014	0,07	
EUR	100.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	105.111	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.00% 15/09/2027	101.002	0,07	
EUR	180.000	United Group BV 4.63% 15/08/2028	187.704	0,13	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.25% 15/01/2029	97.434	0,06	
EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 3.25% 18/11/2030	120.296	0,08	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 1.50% 08/06/2028	101.430	0,07	
EUR	100.000	VZ Secured Financing BV Bond 3.50% 15/01/2032	102.600	0,07	EUR	100.000	Cellnex Finance Company SA 2.25% 12/04/2026	110.438	0,08	
EUR	100.000	Vz Vendor Financing II BV 2.88% 15/01/2029	100.733	0,07	EUR	100.000	Cellnex Telecom SA 1.88% 26/06/2029	101.008	0,07	
EUR	100.000	ZF Europe Finance BV 3.00% 23/10/2029	99.645	0,07	EUR	144.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	152.748	0,11	
<b>Niederlande, insgesamt</b>				<b>5.311.375</b>	<b>3,71</b>	EUR	200.000	Grifols SA 2.25% 15/11/2027	213.043	0,15
<b>NORWEGEN</b>						EUR	100.000	Grifols SA 3.20% 01/05/2025	110.878	0,08
USD	244.000	Kommunalbanken AS 0.38% 11/09/2025	225.793	0,16	EUR	100.000	Kaixo Bondco Telecom SA 5.13% 30/09/2029	104.683	0,07	
<b>Norwegen, insgesamt</b>				<b>225.793</b>	<b>0,16</b>	EUR	372.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	399.908	0,29
<b>PANAMA</b>						<b>Spanien, insgesamt</b>		<b>1.587.586</b>	<b>1,12</b>	
EUR	201.000	Carnival Corp. 7.63% 01/03/2026	229.424	0,16	<b>SCHWEDEN</b>					
<b>Panama, insgesamt</b>				<b>229.424</b>	<b>0,16</b>	EUR	162.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	152.813	0,11
<b>PORTUGAL</b>						EUR	100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	93.508	0,07
EUR	100.000	EDP - Energias de Portugal SA FRN 14/03/2082	100.536	0,07	EUR	100.000	Heimstaden Bostad AB Perp FRN	105.165	0,07	
						EUR	135.000	Intrum AB 3.50% 15/07/2026	144.425	0,10
						EUR	100.000	Intrum AB 4.88% 15/08/2025	112.326	0,08
						EUR	100.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	104.436	0,07
						EUR	100.000	Sagax AB 2.25% 13/03/2025	112.263	0,08
						EUR	199.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	208.442	0,15
						EUR	100.000	Verisure Holding AB 3.88% 15/07/2026	108.981	0,08

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>SCHWEDEN (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				
EUR	155.000	Verisure Midholding AB 5.25% 15/02/2029	159.643	0,11	GBP	100.000	Inspired Entertainment Financing plc 7.88% 01/06/2026	133.312	0,09
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>1.302.002</b>	<b>0,92</b>	EUR	100.000	International Game Technology plc 2.38% 15/04/2028	104.070	0,07
<b>SCHWEIZ</b>					EUR	100.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	113.897	0,08
EUR	100.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	90.444	0,06	EUR	190.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	213.390	0,15
USD	200.000	UBS AG 5.13% 15/05/2024	204.866	0,14	GBP	287.000	Iron Mountain UK plc 3.88% 15/11/2025	376.825	0,26
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>295.310</b>	<b>0,20</b>	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 2.20% 15/01/2024	107.809	0,08
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 4.50% 15/07/2028	100.919	0,07
EUR	103.000	BCP V Modular Services Finance II plc 4.75% 30/11/2028	109.961	0,08	EUR	136.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	154.379	0,11
GBP	167.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	179.340	0,13	EUR	100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 6.88% 15/11/2026	114.549	0,08
USD	94.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	94.762	0,07	GBP	200.000	Jerrold Finco plc 5.25% 15/01/2027	254.365	0,18
EUR	142.000	BP Capital Markets plc Perp FRN	158.702	0,11	GBP	32.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	47.547	0,03
EUR	100.000	British American Tobacco plc Perp FRN	101.557	0,07	GBP	201.000	Marks & Spencer plc 3.75% 19/05/2026	259.755	0,18
GBP	75.000	Broadgate Financing plc 5.00% 05/10/2031	108.456	0,08	EUR	100.000	National Grid Electricity Transmission plc 0.82% 07/07/2032	99.170	0,07
EUR	100.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	100.786	0,07	EUR	100.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	101.098	0,07
GBP	100.000	Constellation Automotive Financing plc 4.88% 15/07/2027	120.704	0,08	EUR	100.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	102.652	0,07
GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	131.665	0,09	EUR	300.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	335.946	0,24
GBP	167.000	Co-Operative Group Limited 5.13% 17/05/2024	220.849	0,15	GBP	204.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	264.911	0,19
GBP	237.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	298.744	0,21	GBP	100.000	Rolls-Royce plc 5.75% 15/10/2027	137.549	0,10
EUR	155.000	DS Smith plc 0.88% 12/09/2026	164.452	0,12	GBP	15.000	Santander UK plc Perp 10.06%	34.734	0,02
EUR	109.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	119.460	0,08	EUR	171.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	181.947	0,13
USD	166.342	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	163.789	0,11	EUR	100.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	111.784	0,08
EUR	19.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	22.419	0,02	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	125.322	0,09
GBP	39.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	60.583	0,04	GBP	93.531	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	146.016	0,10
EUR	123.000	Ineos Finance plc 2.88% 01/05/2026	130.779	0,09	EUR	100.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	105.759	0,07
EUR	186.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	203.491	0,14	GBP	100.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	130.793	0,09
EUR	100.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	105.413	0,07	EUR	200.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	214.548	0,15
EUR	119.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	125.441	0,09					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				
GBP	181.000	Virgin Media Secured Finance plc 5.25% 15/05/2029	234.531	0,17	USD	106.000	Bank of America Corp. FRN 11/03/2032	97.397	0,07
EUR	222.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	228.372	0,16	USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 04/02/2033	28.166	0,02
EUR	100.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	108.288	0,08	USD	42.000	Bank of America Corp. FRN 23/07/2030	40.674	0,03
GBP	255.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	340.413	0,24	USD	137.000	BAT Capital Corp. 4.70% 02/04/2027	140.152	0,10
USD	231.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	238.450	0,17	USD	16.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 4.25% 15/01/2049	17.468	0,01
USD	159.000	Vodafone Group plc FRN 04/04/2079	176.267	0,12	USD	25.000	Boeing Company 3.95% 01/08/2059	21.760	0,02
GBP	284.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	344.306	0,24	USD	30.000	Boeing Company 5.93% 01/05/2060	34.895	0,02
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>8.465.026</b>	<b>5,93</b>	USD	15.000	Bristol-Myers Squibb Company 3.70% 15/03/2052	15.135	0,01
					USD	28.000	Broadcom Inc. 4.15% 15/11/2030	28.362	0,02
					USD	52.000	Broadcom Inc. 5.00% 15/04/2030	55.403	0,04
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					EUR	200.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	208.872	0,15
USD	83.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	87.148	0,06	USD	57.000	Charter Communications Operating LLC 3.95% 30/06/2062	46.254	0,03
USD	32.000	AbbVie Inc. 4.88% 14/11/2048	36.497	0,03	USD	41.000	Chubb Ina Holdings Inc. 3.05% 15/12/2061	35.542	0,02
USD	22.000	AEP Texas Inc. 3.45% 15/05/2051	19.640	0,01	USD	21.000	Cigna Corp. 4.90% 15/12/2048	23.708	0,02
USD	70.000	Amazon.com Inc. 3.10% 12/05/2051	66.057	0,05	USD	150.000	Citigroup Inc. FRN 31/03/2031	156.111	0,12
USD	32.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	31.431	0,02	USD	17.000	Commonwealth Edison Company 4.00% 01/03/2049	17.781	0,01
USD	35.000	Amgen Inc. 3.15% 21/02/2040	32.081	0,02	USD	15.000	Consolidated Edison Co of NY 3.95% 01/04/2050	15.536	0,01
USD	12.000	Amgen Inc. 4.20% 22/02/2052	12.458	0,01	USD	21.000	CSX Corp. 3.80% 15/04/2050	21.277	0,01
USD	148.000	Anheuser-Busch Companies LLC 4.70% 01/02/2036	161.216	0,11	USD	33.000	CVS Health Corp. 5.05% 25/03/2048	37.489	0,03
USD	50.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 4.35% 01/06/2040	52.155	0,04	USD	46.000	Duke Energy Progress Inc. 4.20% 15/08/2045	48.363	0,03
USD	28.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	32.742	0,02	USD	30.000	Emera USA Finance LP 4.75% 15/06/2046	31.441	0,02
USD	81.000	Apple Inc. 2.65% 11/05/2050	70.723	0,05	USD	53.000	Enterprise Products Operating LLC 4.45% 15/02/2043	53.397	0,04
EUR	219.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	225.184	0,15	USD	94.000	Eversource Energy 2.55% 15/03/2031	86.233	0,06
USD	15.000	AT&T Inc. 3.50% 01/06/2041	13.842	0,01	USD	27.000	Eversource Energy 3.38% 01/03/2032	26.460	0,02
USD	119.000	AT&T Inc. 3.50% 15/09/2053	105.543	0,07	USD	25.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	22.896	0,02
USD	91.000	AT&T Inc. 4.90% 15/08/2037	99.134	0,07	USD	31.000	Eversource Energy 3.45% 15/01/2050	28.391	0,02
EUR	158.000	Avantor Funding Inc. 2.63% 01/11/2025	178.304	0,13					
USD	30.000	Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	26.661	0,02					
USD	53.000	Bank of America Corp. FRN 13/02/2031	48.779	0,03					
USD	136.000	Bank of America Corp. FRN 29/04/2031	125.757	0,09					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
USD	20.000	Federal Home Loan Banks 5.50% 15/07/2036	26.476	0,02	USD	65.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	65.738	0,05
USD	15.000	Fedex Corp. 4.95% 17/10/2048	16.786	0,01	USD	25.000	Microsoft Corp. 4.10% 06/02/2037	27.726	0,02
EUR	100.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.50% 21/05/2027	110.618	0,08	USD	75.000	Morgan Stanley FRN 21/01/2033	70.291	0,05
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 1.36% 07/02/2025	107.340	0,08	GBP	173.000	MPT Operating Partnership 3.69% 05/06/2028	221.713	0,15
EUR	196.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.33% 25/11/2025	214.512	0,15	EUR	203.000	Netflix Inc. 3.63% 15/05/2027	241.729	0,17
EUR	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.39% 17/02/2026	109.317	0,08	EUR	200.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	236.041	0,17
GBP	100.000	Ford Motor Credit Company LLC 2.75% 14/06/2024	127.784	0,09	USD	25.000	Nisource Finance Corp. 4.38% 15/05/2047	25.523	0,02
EUR	323.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	364.277	0,25	USD	115.000	Nisource Finance Corp. 4.80% 15/02/2044	119.912	0,08
GBP	200.000	Ford Motor Credit Company LLC 4.54% 06/03/2025	263.899	0,18	USD	35.000	Occidental Petroleum Corp. 3.20% 15/08/2026	34.491	0,02
EUR	10.000	General Electric Company 4.13% 19/09/2035	13.207	0,01	USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	47.852	0,03
USD	100.000	General Motors Financial Company Inc. 2.40% 15/10/2028	89.901	0,06	USD	28.000	Occidental Petroleum Corp. 6.38% 01/09/2028	31.605	0,02
USD	19.000	Georgia Power Company 3.70% 30/01/2050	17.837	0,01	USD	56.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	64.330	0,05
USD	40.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	40.035	0,03	USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	50.556	0,04
USD	22.000	Intel Corp. 3.05% 12/08/2051	19.832	0,01	USD	30.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	35.620	0,02
USD	36.000	Intel Corp. 4.75% 25/03/2050	42.147	0,03	USD	65.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	83.764	0,06
EUR	200.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	211.837	0,15	EUR	200.000	Olympus Water USA 3.88% 01/10/2028	204.959	0,15
EUR	216.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/03/2029	220.895	0,15	USD	44.000	Oracle Corp. 2.88% 25/03/2031	40.189	0,03
EUR	100.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	107.602	0,08	USD	29.000	Oracle Corp. 3.60% 01/04/2040	25.219	0,02
USD	40.000	JPMorgan Chase & Company FRN 04/02/2032	35.079	0,02	USD	29.000	Oracle Corp. 3.65% 25/03/2041	25.295	0,02
USD	64.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	58.391	0,04	USD	78.000	Pacific Gas and Electric Company 4.95% 01/07/2050	74.256	0,05
USD	110.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	100.864	0,07	USD	20.000	Piedmont Natural Gas Company Inc. 3.35% 01/06/2050	17.914	0,01
USD	33.000	JPMorgan Chase & Company FRN 25/01/2033	31.147	0,02	USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	37.741	0,03
USD	45.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2041	40.820	0,03	USD	39.000	Plains All American Pipeline LP 4.70% 15/06/2044	36.555	0,03
USD	58.000	JPMorgan Chase & Company FRN 24/07/2038	58.837	0,04	USD	33.000	PPL Electric Utilities Corp 4.15% 15/06/2048	34.964	0,02
USD	29.000	Kimco Realty Corp. 2.25% 01/12/2031	25.889	0,02	EUR	100.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	105.549	0,07
USD	78.000	Kinder Morgan Energy Partners LP 5.00% 01/03/2043	80.701	0,05	USD	40.000	Relx Capital Inc. 3.50% 16/03/2023	40.350	0,03
GBP	100.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	138.282	0,10	USD	30.000	San Diego Gas & Electric Company 3.32% 15/04/2050	28.079	0,02
USD	10.000	Kraft Heinz Foods Company 4.38% 01/06/2046	9.963	0,01	USD	37.000	San Diego Gas & Electric Company 4.15% 15/05/2048	39.172	0,03

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>KANADA</b>					
EUR	100.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	114.464	0,08	CAD	47.000	Canada (Govt of) 2.75% 01/12/2048	40.270	0,03
EUR	100.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	101.552	0,07	CAD	200.000	Canada Housing Trust No 1 1.10% 15/03/2031	138.030	0,10
EUR	129.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	143.029	0,10	USD	80.000	Province of Ontario Canada 1.13% 07/10/2030	70.578	0,05
USD	22.000	Southern California Edison Company 4.13% 01/03/2048	21.657	0,02	<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>248.878</b>	<b>0,18</b>
USD	19.000	Southern Company 4.40% 01/07/2046	19.530	0,01	<b>FRANKREICH</b>				
EUR	121.000	Spectrum Brands Inc. 4.00% 01/10/2026	134.204	0,09	EUR	100.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.00% 25/02/2028	105.375	0,07
GBP	50.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	74.698	0,05	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0.38% 23/09/2025	184.759	0,13
USD	23.000	T-Mobile USA Inc. 2.63% 15/02/2029	21.053	0,01	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.00% 21/10/2030	176.003	0,12
USD	50.000	T-Mobile USA Inc. 3.40% 15/10/2052	42.921	0,03	USD	200.000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 1.38% 20/01/2031	180.606	0,13
USD	40.000	Verizon Communications Inc. 2.65% 20/11/2040	34.118	0,02	EUR	95.720	France (Govt of) OAT 0.50% 25/06/2044	90.200	0,06
USD	27.000	Verizon Communications Inc. 3.70% 22/03/2061	25.329	0,02	EUR	15.000	France (Govt of) OAT 0.75% 25/05/2053	13.837	0,01
USD	101.000	Verizon Communications Inc. 4.40% 01/11/2034	107.836	0,08	EUR	57.014	France (Govt of) OAT 1.25% 25/05/2034	64.692	0,05
USD	50.000	Williams Partners LP 4.85% 01/03/2048	53.551	0,03	EUR	58.000	France (Govt of) OAT 1.50% 25/05/2031	68.125	0,05
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>8.409.865</b>	<b>5,88</b>	EUR	100.000	Unedic Asseo 0.25% 16/07/2035	96.325	0,07
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>				<b>Frankreich, insgesamt</b>				<b>979.922</b>	<b>0,69</b>
USD	200.000	Gold Fields Orogen Holdings BVI Limited 5.13% 15/05/2024	204.561	0,14	<b>DEUTSCHLAND</b>				
<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>			<b>204.561</b>	<b>0,14</b>	EUR	104.000	Germany (Govt of) 0.00% 09/10/2026	113.978	0,08
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>50.575.131</b>	<b>35,49</b>	EUR	50.000	Germany (Govt of) 0.00% 15/08/2050	46.646	0,03
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>				<b>Deutschland, insgesamt</b>				<b>160.624</b>	<b>0,11</b>
<b>ÖSTERREICH</b>				<b>ITALIEN</b>					
EUR	5.000	Austria (Govt of) 0.85% 30/06/2120	3.613	0,00	USD	200.000	Italy (Govt of) 1.25% 17/02/2026	184.406	0,13
<b>Österreich, insgesamt</b>			<b>3.613</b>	<b>0,00</b>	EUR	21.000	Italy (Govt of) 1.50% 30/04/2045	19.930	0,01
<b>BELGIEN</b>				EUR	25.000	Italy (Govt of) 2.15% 01/03/2072	23.740	0,02	
EUR	13.000	Kingdom of Belgium (Govt of) 1.70% 22/06/2050	15.158	0,01	EUR	93.000	Italy (Govt of) BPT 0.95% 01/08/2030	96.554	0,07
<b>Belgien, insgesamt</b>			<b>15.158</b>	<b>0,01</b>	<b>Italien, insgesamt</b>			<b>324.630</b>	<b>0,23</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					
<b>JAPAN</b>				<b>SUPRANATIONAL (Fortsetzung)</b>					
JPY	10.450.000	Japan (Govt of) Forty Year Bond 0.40% 20/03/2056	73.091	0,05	USD	150.000	Inter-American Development Bank 3.00% 21/02/2024	151.975	0,11
JPY	24.900.000	Japan (Govt of) Ten Year Bond 0.10% 20/12/2031	202.999	0,14	USD	250.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 18/09/2025	251.251	0,17
JPY	5.050.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/06/2049	36.658	0,03	USD	135.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.75% 11/03/2025	128.213	0,09
JPY	4.500.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.40% 20/03/2050	32.569	0,02	USD	80.000	International Bank for Reconstruction & Development 0.88% 14/05/2030	70.422	0,05
JPY	7.600.000	Japan (Govt of) Thirty Year Bond 0.60% 20/09/2050	57.899	0,04	USD	100.000	International Bank for Reconstruction & Development 1.88% 27/10/2026	97.347	0,07
JPY	5.550.000	Japan (Govt of) Twenty Year Bond 0.50% 20/12/2041	44.141	0,03	AUD	70.000	International Finance Corp. 1.50% 15/04/2035	41.097	0,03
		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>447.357</b>	<b>0,31</b>	USD	200.000	New Development Bank 0.63% 29/09/2025	181.196	0,12
							<b>Supranational, insgesamt</b>	<b>1.211.389</b>	<b>0,86</b>
<b>MEXIKO</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
USD	2.000.000	Mexico (Govt of) 5.75% 12/10/2110	2.036.199	1,42	GBP	59.000	United Kingdom Gilt 0.13% 30/01/2026	74.098	0,05
		<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>2.036.199</b>	<b>1,42</b>	GBP	161.000	United Kingdom Gilt 0.13% 31/01/2028	196.447	0,14
					GBP	103.000	United Kingdom Gilt 0.63% 31/07/2035	116.758	0,08
					GBP	21.000	United Kingdom Gilt 0.88% 31/07/2033	25.334	0,02
					GBP	3.000	United Kingdom Gilt 1.13% 31/01/2039	3.539	0,00
					GBP	62.000	United Kingdom Gilt 1.75% 22/01/2049	80.920	0,06
							<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>497.096</b>	<b>0,35</b>
<b>SPANIEN</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>					
EUR	45.000	Instituto de Credito Oficial 0.00% 30/04/2027	47.764	0,03	USD	40.000	United States Treasury N/B 0.25% 15/06/2024	38.166	0,03
EUR	9.000	Spain (Govt of) 0.10% 30/04/2031	9.015	0,01	USD	97.000	United States Treasury N/B 0.50% 31/10/2027	87.111	0,06
EUR	11.000	Spain (Govt of) 1.00% 30/07/2042	10.601	0,01	USD	80.000	United States Treasury N/B 0.63% 15/08/2030	69.494	0,05
EUR	19.000	Spain (Govt of) 1.45% 31/10/2071	15.446	0,01	USD	34.200	United States Treasury N/B 0.75% 31/05/2026	31.811	0,02
EUR	18.000	Spain (Govt of) 2.90% 31/10/2046	24.134	0,02	USD	132.000	United States Treasury N/B 0.75% 31/01/2028	119.790	0,08
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>106.960</b>	<b>0,08</b>					
<b>SUPRANATIONAL</b>									
USD	80.000	Asian Development Bank 0.75% 08/10/2030	69.754	0,05					
USD	124.000	Asian Development Bank 1.75% 19/09/2029	117.498	0,08					
USD	25.000	European Investment Bank 0.63% 21/10/2027	22.519	0,02					
USD	25.000	European Investment Bank 1.63% 13/05/2031	23.435	0,02					
EUR	8.000	European Union 0.10% 04/10/2040	7.177	0,01					
EUR	18.000	IBRD 0.20% 21/01/2061	13.687	0,01					
USD	40.000	Inter-American Development Bank 1.13% 13/01/2031	35.818	0,03					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

## Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente (Fortsetzung)</b>					<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					<b>KAIMANINSELN</b>				
USD	145.000	United States Treasury N/B 1.00% 31/07/2028	132.698	0,09	46.000	China Mengniu Dairy Company Limited	247.874	0,18	
USD	263.600	United States Treasury N/B 1.13% 15/08/2040	207.234	0,14	74.000	China Resources Land Limited	344.894	0,24	
USD	38.000	United States Treasury N/B 1.25% 15/05/2050	28.363	0,02	195	JD.com Inc. - A	5.827	0,00	
USD	18.000	United States Treasury N/B 1.38% 15/11/2040	14.750	0,01	16.955	NetEase Inc.	311.327	0,22	
USD	149.600	United States Treasury N/B 1.38% 15/08/2050	115.239	0,08	504	Netease.com - ADR	45.204	0,03	
USD	112.200	United States Treasury N/B 1.88% 15/02/2051	98.473	0,07	4.100	Tencent Holdings Limited	195.906	0,14	
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>943.129</b>	<b>0,65</b>		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.151.032</b>	<b>0,81</b>	
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>					<b>CHINA</b>				
			<b>6.974.955</b>	<b>4,89</b>	148.300	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	157.688	0,11	
<b>Aktien</b>					302.000	China Construction Bank Corp.	227.134	0,16	
<b>AUSTRALIEN</b>					48.500	China Merchants Bank Company Limited - H	381.180	0,27	
	5.200	Aristocrat Leisure Limited	143.311	0,10	35.100	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	203.972	0,14	
	19.303	Australia & New Zealand Banking Group Limited	400.078	0,28	37.000	Ping An Insurance Group Company of China Limited	262.922	0,18	
	2.191	Carsales.Com Limited	34.420	0,02	3.700	Wuliangye Yibin Company Limited - A	90.377	0,06	
	107.542	Deterra Royalties Limited	390.064	0,27		<b>China, insgesamt</b>	<b>1.323.273</b>	<b>0,92</b>	
	38.060	Dexus Property Group	312.964	0,22		<b>DÄNEMARK</b>			
	3.208	Macquarie Group Limited	489.687	0,34	14.343	Tryg A/S	352.389	0,25	
	11.612	Oz Minerals Limited	232.563	0,16		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>352.389</b>	<b>0,25</b>	
	39.074	Transurban Group	397.593	0,28		<b>FINNLAND</b>			
		<b>Australien, insgesamt</b>	<b>2.400.680</b>	<b>1,67</b>	7.828	Upm-Kymmene Oyj	258.333	0,18	
<b>BELGIEN</b>						<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>258.333</b>	<b>0,18</b>	
	3.144	KBC Group NV	228.710	0,16		<b>FRANKREICH</b>			
	2.688	Melexis NV	251.227	0,18	852	Air Liquide SA	150.653	0,11	
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>479.937</b>	<b>0,34</b>	12.366	AXA SA	365.509	0,26	
<b>KANADA</b>					2.973	BNP Paribas	171.780	0,12	
	675	Canadian National Railway Company	90.627	0,06	3.382	Compagnie de Saint-Gobain	204.217	0,14	
	3.263	Manulife Financial Corp.	69.646	0,05	2.912	Edenred	145.542	0,10	
	514	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	30.341	0,02	372	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	268.790	0,19	
	2.319	Suncor Energy Inc.	75.564	0,05	3.682	Nexity SA	130.687	0,09	
		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>266.178</b>	<b>0,18</b>	1.042	Pernod-Ricard SA	231.065	0,16	
					1.775	Schneider Electric SE	300.509	0,21	
					6.428	Total SA	329.212	0,23	
					2.278	Vinci SA	235.694	0,17	
						<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>2.533.658</b>	<b>1,78</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>IRLAND (Fortsetzung)</b>					
2.690	Brenntag AG	219.509	0,15	1.426	Experian plc	55.406	0,04		
3.907	Daimler Truck Holding AG	109.678	0,08	205	Linde plc	65.483	0,05		
3.668	Deutsche Telekom AG - Reg	69.103	0,05	2.634	Medtronic Inc.	292.242	0,20		
3.752	E.ON AG	44.009	0,03	3.647	Trinseo plc	174.764	0,12		
1.525	Evonik Industries AG	42.725	0,03	<b>Irland, insgesamt</b>			<b>1.828.975</b>	<b>1,27</b>	
3.222	Mercedes-Benz Group AG - Reg	228.756	0,15	<b>ITALIEN</b>					
107	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	28.930	0,02	30.414	Enel SpA	205.342	0,14		
1.697	SAP SE	190.931	0,13	9.721	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	109.945	0,08		
2.839	Siemens AG - Reg	396.936	0,28	14.790	Nexi SpA	172.789	0,12		
1.775	Siemens Healthineers AG	111.071	0,08	<b>Italien, insgesamt</b>			<b>488.076</b>	<b>0,34</b>	
620	Volkswagen AG Pfd	108.305	0,08	<b>JAPAN</b>					
3.626	Vonovia SE	170.698	0,12	200	Disco Corp.	56.683	0,04		
<b>Deutschland, insgesamt</b>			<b>1.720.651</b>	<b>1,20</b>	800	Rohm Company Limited	63.209	0,04	
<b>HONGKONG</b>				4.900	Z Holdings Corp.	21.655	0,02		
43.800	AIA Group Limited	461.132	0,32	<b>Japan, insgesamt</b>			<b>141.547</b>	<b>0,10</b>	
33.000	Galaxy Entertainment Group Limited	198.049	0,14	<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
5.100	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	241.865	0,17	23.911	WPP plc	315.769	0,22		
25.000	Sun Hung Kai Properties Limited	298.797	0,21	<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>			<b>315.769</b>	<b>0,22</b>	
95.000	Xinyi Glass Holdings Limited	230.483	0,17	<b>NIEDERLANDE</b>					
<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>1.430.326</b>	<b>1,01</b>	518	Akzo Nobel NV	45.082	0,03	
<b>INDIEN</b>				840	ASM International NV	310.389	0,22		
53.600	Embassy Office Parks REIT	262.961	0,18	16.716	ING Groep NV	176.896	0,12		
10.964	HDFC Bank Limited	212.748	0,15	915	Koninklijke DSM NV	165.437	0,12		
31.951	Hindalco Industries Limited	240.134	0,17	896	Philips NV	27.645	0,02		
53.158	Petronet Lng Limited	135.921	0,10	<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>725.449</b>	<b>0,51</b>	
15.379	Tech Mahindra Limited	304.323	0,21	<b>NORWEGEN</b>					
<b>Indien, insgesamt</b>			<b>1.156.087</b>	<b>0,81</b>	1.938	Equinor ASA	73.406	0,05	
<b>INDONESIEN</b>				<b>Norwegen, insgesamt</b>				<b>73.406</b>	<b>0,05</b>
877.221	Bank Rakyat Indonesia	284.637	0,20	<b>SÜDKOREA</b>					
930.800	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	296.837	0,21	9.404	Hanon Systems	91.553	0,06		
<b>Indonesien, insgesamt</b>			<b>581.474</b>	<b>0,41</b>	6.066	KB Financial Group Inc.	306.791	0,22	
<b>IRLAND</b>				2.141	Kia Corp.	130.716	0,09		
1.407	CRH plc	56.906	0,04	10.398	Kt Corp.	306.266	0,21		
5.095	CRH plc	206.080	0,14	826	Posco Holdings Inc.	199.677	0,14		
6.445	Eaton Corp. plc	978.094	0,68	1.986	Samsung Electronics Company Limited	114.043	0,08		

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

## Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>SÜDKOREA (Fortsetzung)</b>				<b>THAILAND</b>			
10.838	Samsung Electronics Company Limited Pfd	563.339	0,40	83.200	PTT Exploration & Production plc	360.323	0,25
3.680	SK Telecom Company Limited	172.759	0,12	556.500	Thai Beverage plc	294.009	0,21
<b>Südkorea, insgesamt</b>		<b>1.885.144</b>	<b>1,32</b>	<b>Thailand, insgesamt</b>		<b>654.332</b>	<b>0,46</b>
<b>SINGAPUR</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
194.600	Capitamall Trust	323.530	0,23	23.495	3i Group plc	429.528	0,30
800	DBS Group Holdings Limited	21.180	0,01	5.006	Anglo American plc	261.834	0,19
205.500	Digital Core REIT Management Pte Limited	228.105	0,16	2.878	Astrazeneca plc	383.934	0,27
73.100	Keppel Corp. Limited	346.771	0,24	31.373	BT Group plc	75.262	0,05
17.100	United Overseas Bank Limited	404.583	0,28	961	Diageo plc	48.885	0,03
<b>Singapur, insgesamt</b>		<b>1.324.169</b>	<b>0,92</b>	12.139	Glaxosmithkline plc	263.269	0,18
				89.334	Ibstock plc	206.308	0,15
				2.207	London Stock Exchange Group plc	231.480	0,16
				6.671	Persimmon plc	188.930	0,13
				838	Reckitt Benckiser Group plc	64.348	0,05
				14.014	St James's Place plc	267.270	0,19
				1.046.843	Supermarket Income Reit plc	1.743.582	1,23
				1.100.000	Target Healthcare REIT plc	1.625.009	1,14
				216.124	Vodafone Group plc	355.244	0,25
				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>		<b>6.144.883</b>	<b>4,32</b>
				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
				7.678	American Electric Power Company Inc.	766.034	0,54
				184	American Tower Corp.	46.224	0,03
				389	Analog Devices Inc.	64.255	0,05
				177	Anthem Inc.	86.946	0,06
				3.205	Apple Inc.	559.625	0,39
				13.727	AT&T Inc.	324.369	0,23
				3.007	Automatic Data Processing Inc.	684.214	0,48
				670	BlackRock Inc.	511.994	0,36
				10.906	Bristol-Myers Squibb Company	796.465	0,56
				2.027	Broadcom Inc.	1.276.362	0,91
				3.713	Caterpillar Inc.	827.330	0,59
				3.456	Chevron Corp.	562.740	0,39
				14.921	Cisco Systems Inc.	831.995	0,58
				2.587	CME Group Inc.	615.344	0,44
				1.265	Coca Cola Company	78.430	0,05
				15.237	Comcast Corp.	713.396	0,50
				16.028	Conocophillips	1.602.800	1,13
				382	Crown Castle International Corp.	70.517	0,05
				5.321	DuPont de Nemours Inc.	391.519	0,27
				9.519	Ebay Inc.	545.058	0,38
				4.902	Edison International	343.630	0,24
<b>Taiwan, insgesamt</b>				<b>Taiwan, insgesamt</b>			
23.000	Chailease Holding Company Limited	203.496	0,14				
36.000	Chroma ATE Inc.	226.165	0,16				
5.000	MediaTek Inc.	157.932	0,11				
59.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	1.229.354	0,86				
14.000	Yageo Corp.	212.065	0,15				
<b>Taiwan, insgesamt</b>		<b>2.029.012</b>	<b>1,42</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
4.125	Eli Lilly & Company	1.181.276	0,82	8.010	Xcel Energy Inc.	578.082	0,41
6.107	Equity Lifestyle Properties Inc.	467.063	0,33				
504	Fidelity National Information Services Inc.	50.612	0,04		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>38.507.958</b>	<b>27,04</b>
1.961	General Motors Company	85.774	0,06		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>69.746.098</b>	<b>48,91</b>
106	Grainger (WWW) Inc.	54.674	0,04				
3.631	Home Depot Inc.	1.086.868	0,77		<b>Wandelanleihen</b>		
305	IBM Corp.	39.656	0,03				
672	IntercontinentalExchange Inc.	88.785	0,06		<b>KANADA</b>		
6.260	Johnson & Johnson	1.109.460	0,78	USD 149.000	Air Canada 4.00% 01/07/2025	216.959	0,15
2.913	JPMorgan Chase & Company	397.100	0,28		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>216.959</b>	<b>0,15</b>
2.824	KLA Corp.	1.033.753	0,72		<b>Wandelanleihen, insgesamt</b>	<b>216.959</b>	<b>0,15</b>
8.969	Kontoor Brands Inc.	370.869	0,26				
4.742	Lamb Weston Holding Inc.	284.093	0,20		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>127.513.143</b>	<b>89,44</b>
295	Marsh & McLennan Companies Inc.	50.274	0,04				
1.043	Mastercard Inc. - A	372.747	0,26		<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>		
283	McDonald's Corp.	69.980	0,05				
8.974	Merck & Company Inc.	736.317	0,52		<b>Anleihen</b>		
10.496	Metlife Inc.	737.659	0,51				
8.666	Microsoft Corp.	2.671.815	1,88		<b>AUSTRALIEN</b>		
6.384	Moelis & Company - A	299.729	0,21	USD 35.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	35.947	0,03
7.965	Morgan Stanley	696.141	0,50				
5.424	NextEra Energy Inc.	459.467	0,32	USD 137.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	141.533	0,10
4.095	Northern Trust Corp.	476.863	0,33		<b>Australien, insgesamt</b>	<b>177.480</b>	<b>0,13</b>
24.515	Nortonlifelock Inc.	650.138	0,46				
5.818	PepsiCo Inc.	973.816	0,69		<b>BERMUDAS</b>		
9.817	Philip Morris International Inc.	922.209	0,65	USD 100.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	104.435	0,07
7.512	Procter & Gamble Company	1.147.834	0,80		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>104.435</b>	<b>0,07</b>
6.399	Prologis Inc.	1.033.311	0,72				
220	Qualcomm Inc.	33.620	0,02		<b>KANADA</b>		
455	Quest Diagnostics Inc.	62.271	0,04	USD 18.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	17.866	0,01
7.801	Raytheon Technologies Corp.	772.845	0,54		<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>17.866</b>	<b>0,01</b>
1.027	SBA Communications	353.391	0,24				
350	Stanley Works	48.927	0,03		<b>NIEDERLANDE</b>		
6.325	Starbucks Corp.	575.385	0,40	USD 15.000	E.ON International Finance BV 6.65% 30/04/2038	18.827	0,01
1.154	State Street Corp.	100.536	0,07		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>18.827</b>	<b>0,01</b>
11.004	Store Capital Corp.	321.647	0,23				
3.242	Target Corp.	688.017	0,48				
4.056	Texas Instruments Inc.	744.195	0,52				
8.457	Tjx Companies Inc.	512.325	0,36				
12.263	Truist Financial Corp.	695.312	0,49				
3.870	Union Pacific Corp.	1.057.323	0,74				
5.026	United Parcel Service Inc.	1.077.875	0,76				
4.582	Valero Energy Corp.	465.256	0,33				
14.009	Verizon Communications Inc.	713.618	0,50				
3.608	Virtu Financial Inc.	134.290	0,09				
4.906	Voya Financial Inc.	325.513	0,23				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>						
USD	21.000	American Transmission Systems Inc. 2.65% 15/01/2032	19.381	0,01	USD	180.000	Fannie Mae 5.63% 15/07/2037	239.678	0,17	
USD	48.000	Atlantic City Electric 2.30% 15/03/2031	44.637	0,03	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>239.678</b>	<b>0,17</b>	
USD	119.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	111.960	0,08	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>239.678</b>	<b>0,17</b>
USD	25.000	Guardian Life Insurance Company of America 4.85% 24/01/2077	27.688	0,02	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>1.583.462</b>	<b>1,11</b>
USD	47.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	43.855	0,03	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>					
USD	57.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	58.470	0,04	<b>Anleihen</b>					
USD	50.000	Magallanes Inc. 5.39% 15/03/2062	51.826	0,04	<b>KANADA</b>					
USD	35.000	Metropolitan Edison Company 4.30% 15/01/2029	36.402	0,03	CAD	50.000	Rogers Communications Inc. 3.65% 31/03/2027	39.609	0,03	
USD	156.000	Metropolitan Life Global Funding I 1.55% 07/01/2031	134.561	0,09	<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>39.609</b>	<b>0,03</b>	
USD	17.000	New York Life Insurance Company 4.45% 04/04/2069	17.700	0,01	<b>PORTUGAL</b>					
USD	18.000	Northwestern Mutual 3.85% 30/09/2047	17.703	0,01	EUR	100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	12.239	0,01	
USD	86.000	Northwestern Mutual L 3.45% 30/03/2051	78.513	0,06	<b>Portugal, insgesamt</b>			<b>12.239</b>	<b>0,01</b>	
USD	8.000	Northwestern Mutual Life Insurance Co/The 3.63% 30/09/2059	7.314	0,01	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					
USD	45.000	Occidental Petroleum Corp. 6.95% 01/07/2024	48.431	0,03	EUR	100.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	101.507	0,07	
USD	25.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	31.250	0,02	GBP	235.000	Bellis Acquisition Company 3.25% 16/02/2026	286.640	0,19	
USD	200.000	Roche Holdings Inc. 1.93% 13/12/2028	186.261	0,13	GBP	100.000	Bracken Midco1 plc 6.75% 01/11/2027	127.162	0,09	
USD	11.000	Teachers Insurance & Annuity Association America 4.90% 15/09/2044	12.198	0,01	GBP	205.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	261.496	0,17	
USD	75.000	Teachers Insurance & Annuity Association of America 4.27% 15/05/2047	79.941	0,06	GBP	100.000	Pinewood Finance Company Limited 3.63% 15/11/2027	123.597	0,09	
USD	20.000	T-Mobile USA Inc. 3.60% 15/11/2060	17.085	0,01	GBP	100.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	125.100	0,09	
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>		<b>1.025.176</b>	<b>0,72</b>	GBP	166.000	Talktalk Telecom Group plc 3.88% 20/02/2025	190.705	0,13		
<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>1.343.784</b>	<b>0,94</b>	GBP	145.000	Vmed O2 UK Financing I plc 4.50% 15/07/2031	176.056	0,12		
				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>				<b>1.392.263</b>	<b>0,95</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
USD	45.000	Broadcom Inc. 2.45% 15/02/2031	
		40.013	0,03
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>40.013</b>
			<b>0,03</b>
		<b>Anleihen, insgesamt</b>	<b>1.484.124</b>
			<b>1,02</b>
		<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>	<b>1.484.124</b>
			<b>1,02</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

#### Fonds

#### LUXEMBURG

20.271	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income Fund XUP***	286.675	0,20
24.810	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds XUP***	214.969	0,15
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>501.644</b>	<b>0,35</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>501.644</b>	<b>0,35</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>501.644</b>	<b>0,35</b>

### Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Fonds

#### VEREINIGTES KÖNIGREICH

USD	106.746	Threadneedle Specialist Investment Funds ICVC - Emerging Market Local Fund****	
		297.790	0,21
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>297.790</b>
			<b>0,21</b>
		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>297.790</b>
			<b>0,21</b>
		<b>Sonstige Organismen für gemeinsame Anlagen, insgesamt</b>	<b>297.790</b>
			<b>0,21</b>
		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>131.380.163</b>
			<b>92,13</b>

(Gesamtkosten: USD 124.614.784)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

\*\*\*Siehe Erläuterung 18.

\*\*\*\*Fonds der verbundenen Partei.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>BRASILIEN</b>				<b>HONGKONG</b>				
20.622	Azul SA	103.805	1,70	9.000	AIA Group Limited	94.753	1,55	
17.816	Itau Unibanco Holding SA - ADR	101.729	1,67	1.300	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	61.652	1,01	
11.131	Localiza Rent a Car	143.122	2,34	7.476	Techtronic Industries Company	121.141	1,99	
	<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>348.656</b>	<b>5,71</b>		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>277.546</b>	<b>4,55</b>	
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDIEN</b>				
2.281	Afya Limited	32.869	0,54	1.385	Apollo Hospitals Enterprise Limited	82.544	1,36	
1.363	Dlocal Limited	42.607	0,70	1.334	Bajaj Finance Limited	127.810	2,10	
885	JD.com Inc. - A	26.444	0,43	4.986	HDFC Bank Limited - ADR	305.791	5,02	
10.088	Kingdee International Software Group Company Limited	22.440	0,37	10.177	Hdfc Standard Life Insurance	72.283	1,19	
7.900	Meituan Dianping - B	156.963	2,58	11.749	ICICI Bank Limited - ADR	222.526	3,65	
3.500	Pagseguro Digital Limited	70.175	1,15	6.698	Infosys Technologies Limited - ADR	166.713	2,74	
1.000	Parade Technologies Limited	63.173	1,04	2.849	Reliance Industries Limited	99.062	1,63	
511	Sea Limited	61.213	1,00		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>1.076.729</b>	<b>17,69</b>	
3.900	Shenzhou International Group Holdings Limited	52.190	0,86					
7.500	Tencent Holdings Limited	358.365	5,88					
9.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	78.910	1,29					
2.366	Xp Inc. - A	71.217	1,17					
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.036.566</b>	<b>17,01</b>					
<b>CHINA</b>				<b>INDONESIEN</b>				
1.138	Bafang Electric Suzhou Company Limited	31.284	0,51	286.200	Bank Central Asia Tbk Pt	158.927	2,61	
1.343	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	39.700	0,65	781.536	Bank Rakyat Indonesia	253.590	4,16	
400	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	32.280	0,53		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>412.517</b>	<b>6,77</b>	
17.000	Country Garden Services Holdings	72.937	1,20					
2.764	JD.com Inc. - ADR	159.953	2,62					
1.600	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	77.440	1,27					
5.940	WuXi AppTec Company Limited - H	94.431	1,55					
	<b>China, insgesamt</b>	<b>508.025</b>	<b>8,33</b>					
<b>ZYPERN</b>				<b>KASACHSTAN</b>				
1.129	Ozon Holdings plc**	0	0,00	625	Kaspi.Kz Jsc	31.313	0,51	
545	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00		<b>Kasachstan, insgesamt</b>	<b>31.313</b>	<b>0,51</b>	
	<b>Zypern, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>					
					<b>LUXEMBURG</b>			
					571	Globant SA	149.642	2,46
						<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>149.642</b>	<b>2,46</b>
					<b>MEXIKO</b>			
				21.245	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	87.272	1,43	
					<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>87.272</b>	<b>1,43</b>	
					<b>SÜDKOREA</b>			
				1.291	Hana Financial Group Inc.	51.766	0,85	
				409	Naver Corp.	114.900	1,89	
				102	Samsung Biologics Company Limited	69.596	1,14	
				602	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	81.952	1,34	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Rechte</b>			
<b>SÜDKOREA (Fortsetzung)</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
7.882	Samsung Electronics Company Limited	452.612	7,43	7	Samsung Biologics Company Limited Right	1.149	0,02
189	Samsung Sdi Company Limited	92.937	1,52				
1.306	SK hynix Inc.	127.147	2,09		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>1.149</b>	<b>0,02</b>
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>990.910</b>	<b>16,26</b>		<b>Rechte, insgesamt</b>	<b>1.149</b>	<b>0,02</b>
<b>SÜDAFRIKA</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
807	Capitec Bank Holdings Limited	129.317	2,12			<b>6.087.459</b>	<b>99,89</b>
	<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>129.317</b>	<b>2,12</b>		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>6.087.459</b>	<b>99,89</b>
<b>TAIWAN</b>				<b>(Gesamtkosten: USD 6.530.850)</b>			
54.000	Cathay Financial Holding Company Limited	121.564	2,00				
7.000	Delta Electronics Inc.	65.599	1,08				
2.000	MediaTek Inc.	63.173	1,04				
4.528	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	472.088	7,74				
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>722.424</b>	<b>11,86</b>				
<b>THAILAND</b>				<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
12.200	Kasikornbank pcl	59.257	0,97				
67.300	Muangthai Capital pcl	106.262	1,74				
	<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>165.519</b>	<b>2,71</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
126	Mercadolibre Inc.	149.874	2,46				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>149.874</b>	<b>2,46</b>				
<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>							
12.165	Fix Price Group Limited**	0	0,00				
	<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>				
<b>Aktien, insgesamt</b>		<b>6.086.310</b>	<b>99,87</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
425.773	Novo Nordisk A/S	47.695.607	1,99	42.525	Lonza Group AG - Reg	31.062.536	1,29
1.939.887	Tryg A/S	47.660.462	1,98	178.557	Nestle SA - Reg	23.322.518	0,97
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>95.356.069</b>	<b>3,97</b>	74.475	Sika AG	24.877.599	1,03
				<b>Schweiz, insgesamt</b>			
				<b>79.262.653 3,29</b>			
<b>FRANKREICH</b>				<b>TAIWAN</b>			
60.430	L'Oreal SA	24.464.342	1,02	2.560.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	53.341.425	2,22
71.151	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	51.410.504	2,14		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>53.341.425</b>	<b>2,22</b>
105.985	Pernod-Ricard SA	23.502.295	0,98				
172.600	Schneider Electric SE	29.221.322	1,21				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>128.598.463</b>	<b>5,35</b>				
				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
				157.337	Linde plc	50.855.224	2,12
				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
				<b>50.855.224 2,12</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
343.565	Zalando SE	17.584.309	0,73	364.414	Abbott Laboratories	43.132.041	1,79
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>17.584.309</b>	<b>0,73</b>	205.176	Adobe Systems Inc.	93.482.289	3,89
				53.548	Alphabet Inc. - A	148.935.730	6,19
				43.502	Amazon.com Inc.	141.814.345	5,90
				240.603	American Electric Power Company Inc.	24.004.961	1,00
				68.332	Anthem Inc.	33.566.045	1,40
				272.414	Apple Inc.	47.566.209	1,98
				88.534	Cintas Corp.	37.661.479	1,56
				384.839	Coca Cola Company	23.860.018	0,99
				240.712	Conocophillips	24.071.200	1,00
				208.205	Doximity Inc.	10.845.398	0,45
				226.293	Edwards Lifesciences Corp.	26.639.212	1,11
				165.769	Eli Lilly & Company	47.471.269	1,97
				381.000	IntercontinentalExchange Inc.	50.337.720	2,09
				254.555	Intuit Inc.	122.400.227	5,09
				147.493	Lam Research Corp.	79.293.711	3,29
				141.620	Marsh & McLennan Companies Inc.	24.134.880	1,00
				361.431	Mastercard Inc. - A	129.168.210	5,38
				640.558	Microsoft Corp.	197.490.438	8,20
				88.722	Nvidia Corp.	24.208.685	1,01
				353.166	Qualcomm Inc.	53.970.828	2,24
				56.789	S&P Global Inc.	23.293.712	0,97
				102.519	Stryker Corp.	27.408.455	1,14
				134.299	Thermo Fisher Scientific Inc.	79.323.705	3,30
				276.869	T-Mobile USA Inc.	35.536.136	1,48
				267.401	Transunion	27.633.219	1,15
				87.620	Union Pacific Corp.	23.938.660	1,00
<b>HONGKONG</b>							
2.136.200	AIA Group Limited	22.490.176	0,94				
1.163.000	Techtronic Industries Company	18.845.238	0,78				
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>41.335.414</b>	<b>1,72</b>				
<b>INDIEN</b>							
1.011.023	Kotak Mahindra Bank Limited	23.400.692	0,97				
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>23.400.692</b>	<b>0,97</b>				
<b>IRLAND</b>							
287.507	Trane Technologies plc	43.902.319	1,83				
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>43.902.319</b>	<b>1,83</b>				
<b>JAPAN</b>							
355.300	Hoya Corp.	41.069.904	1,71				
105.112	Keyence Corp.	49.579.096	2,06				
1.321.400	Recruit Holdings Company Limited	58.941.796	2,45				
5.239.600	Z Holdings Corp.	23.155.689	0,96				
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>172.746.485</b>	<b>7,18</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>							
42.001	ASML Holding NV	28.506.772	1,19				
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>28.506.772</b>	<b>1,19</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Focus

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
222.686	United Parcel Service Inc.	47.757.240	1,98
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.648.946.022</b>	<b>68,55</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>2.383.835.847</b>	<b>99,12</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>2.383.835.847</b>	<b>99,12</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
20.515.958	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	20.515.958	0,85
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>20.515.958</b>	<b>0,85</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>20.515.958</b>	<b>0,85</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>20.515.958</b>	<b>0,85</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>2.404.351.805</b>	<b>99,97</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 2.122.956.477)</b>			

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BRASILIEN</b>				<b>CHINA (Fortsetzung)</b>			
398.107	Azul SA	2.003.961	1,49	212.500	Li Ning Company Limited	1.834.281	1,37
238.963	Hapvida Participacoes e Investimentos SA	595.403	0,44	75.400	Midea Group Company Limited - A	677.020	0,50
353.522	Itau Unibanco Holding SA - ADR	2.018.611	1,51	18.300	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Company Limited	885.723	0,66
170.661	Localiza Rent a Car	2.194.340	1,64	5.000	Silergy Corp.	598.569	0,45
133.021	Petro Rio SA	666.512	0,50	78.932	WuXi AppTec Company Limited - H	1.254.824	0,94
	<b>Brasilien, insgesamt</b>	<b>7.478.827</b>	<b>5,58</b>	155.100	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	406.067	0,30
<b>KANADA</b>				<b>China, insgesamt</b>			
36.401	Parex Resources Inc.	747.516	0,56			<b>13.619.888</b>	<b>10,15</b>
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>747.516</b>	<b>0,56</b>	<b>ZYPERN</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				31.029	Ozon Holdings plc**	0	0,00
60.276	Afya Limited	868.577	0,65	12.232	Tcs Group Holding plc - Reg**	0	0,00
6.139	Alibaba Group Holding Limited	667.923	0,50		<b>Zypern, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
29.367	Dlocal Limited	918.012	0,68	<b>HONGKONG</b>			
19.807	JD.com Inc. - A	591.827	0,44	196.800	AIA Group Limited	2.071.935	1,54
272.000	Kingdee International Software Group Company Limited	605.031	0,45	21.700	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	1.029.110	0,77
67.000	Kuaishou Technology	634.803	0,47	168.000	Techtronic Industries Company	2.722.270	2,03
158.100	Meituan Dianping - B	3.141.245	2,34		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>5.823.315</b>	<b>4,34</b>
20.868	Netease.com - ADR	1.871.651	1,40	<b>INDIEN</b>			
68.759	Pagseguro Digital Limited	1.378.618	1,03	27.285	Apollo Hospitals Enterprise Limited	1.626.158	1,21
18.000	Parade Technologies Limited	1.137.107	0,85	17.054	Bajaj Finance Limited	1.633.936	1,21
11.438	Sea Limited	1.370.158	1,02	39.508	Balkrishna Industries Limited	1.113.787	0,83
108.400	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.450.611	1,08	167.898	Cholamandalam Investment and Finance Company Limited	1.591.906	1,19
156.600	Tencent Holdings Limited	7.482.657	5,59	12.658	Dixon Technologies India Limited	719.774	0,54
211.500	Wuxi Biologics Cayman Inc.	1.756.782	1,31	23.437	Eicher Motors Limited	759.992	0,57
48.059	Xp Inc. - A	1.446.576	1,08	35.280	HDFC Bank Limited - ADR	2.163.722	1,61
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>25.321.578</b>	<b>18,89</b>	186.525	Hdfc Standard Life Insurance	1.324.817	0,99
<b>CHINA</b>				147.776	ICICI Bank Limited - ADR	2.798.877	2,09
25.350	Bafang Electric Suzhou Company Limited	696.872	0,52	92.346	Infosys Technologies Limited - ADR	2.298.492	1,71
24.903	Beijing Kingsoft Office Software Inc.	736.170	0,55	127.159	Reliance Industries Limited	4.421.420	3,29
33.200	China International Travel Service Corp. Limited - A	859.638	0,64		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>20.452.881</b>	<b>15,24</b>
9.000	Contemporary Amperex Technology Company Limited - A	726.310	0,54	<b>INDONESIEN</b>			
372.895	Country Garden Services Holdings	1.599.875	1,19	6.006.500	Bank Central Asia Tbk Pt	3.335.405	2,49
57.794	JD.com Inc. - ADR	3.344.539	2,49	13.643.566	Bank Rakyat Indonesia	4.427.008	3,29

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>INDONESIEN (Fortsetzung)</b>				<b>SÜDKOREA (Fortsetzung)</b>			
4.509.800	Bank Tabungan Pensiunan Nasional Syariah Tbk Pt	1.036.257	0,77	13.337	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	1.815.609	1,35
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>8.798.670</b>	<b>6,55</b>	134.960	Samsung Electronics Company Limited	7.749.873	5,78
				2.666	Samsung Sdi Company Limited	1.310.952	0,98
				29.278	SK hynix Inc.	2.850.386	2,13
					<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>18.223.255</b>	<b>13,59</b>
<b>KASACHSTAN</b>				<b>SÜDAFRIKA</b>			
6.794	Kaspi.Kz Jsc	340.379	0,25	9.555	Capitec Bank Holdings Limited	1.531.131	1,14
	<b>Kasachstan, insgesamt</b>	<b>340.379</b>	<b>0,25</b>		<b>Südafrika, insgesamt</b>	<b>1.531.131</b>	<b>1,14</b>
<b>LUXEMBURG</b>				<b>TAIWAN</b>			
12.572	Globant SA	3.294.744	2,46	7.000	Asmedia Technology Inc.	475.191	0,35
	<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>3.294.744</b>	<b>2,46</b>	955.000	Cathay Financial Holding Company Limited	2.149.875	1,61
<b>MALAYSIA</b>				40.000	MediaTek Inc.	1.263.452	0,94
308.000	Public Bank Bhd	342.079	0,26	99.949	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited - ADR	10.420.684	7,77
	<b>Malaysia, insgesamt</b>	<b>342.079</b>	<b>0,26</b>	96.493	Unimicron Technology Corp.	838.582	0,63
<b>MEXIKO</b>					<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>15.147.784</b>	<b>11,30</b>
476.661	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1.958.065	1,46	<b>THAILAND</b>			
	<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>1.958.065</b>	<b>1,46</b>	268.700	Kasikornbank pcl	1.305.106	0,97
				1.015.300	Muangthai Capital pcl	1.603.095	1,20
<b>NIEDERLANDE</b>					<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>2.908.201</b>	<b>2,17</b>
33.179	Yandex NV - A**	0	0,00	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>	53.495	Coupage Inc.	945.792	0,71
<b>PHILIPPINEN</b>				2.821	Mercadolibre Inc.	3.355.523	2,50
2.095.300	Ayala Land Inc.	1.419.307	1,06		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>4.301.315</b>	<b>3,21</b>
	<b>Philippinen, insgesamt</b>	<b>1.419.307</b>	<b>1,06</b>	<b>BRITISCHE JUNGFERNINSELN</b>			
<b>POLEN</b>				223.974	Fix Price Group Limited**	0	0,00
11.823	Dino Polska SA	966.039	0,72		<b>Britische Jungferninseln, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Polen, insgesamt</b>	<b>966.039</b>	<b>0,72</b>				
<b>SÜDKOREA</b>					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>132.674.974</b>	<b>98,93</b>
28.501	Hana Financial Group Inc.	1.142.817	0,85				
6.893	Naver Corp.	1.936.447	1,44				
2.077	Samsung Biologics Company Limited	1.417.171	1,06				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Rechte</b>			
<b>SÜDKOREA</b>			
137	Samsung Biologics Company Limited Right	22.493	0,02
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>22.493</b>	<b>0,02</b>
	<b>Rechte, insgesamt</b>	<b>22.493</b>	<b>0,02</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>132.697.467</b>	<b>98,95</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
<b>RUSSISCHE FÖDERATION</b>			
597.602	Detsky Mir PJSC**	0	0,00
	<b>Russische Föderation, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>132.697.467</b>	<b>98,95</b>

(Gesamtkosten: USD 125.309.026)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>HONGKONG</b>			
105.874	Carsales.Com Limited	1.663.267	0,77	216.000	AIA Group Limited	2.274.075	1,05
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>1.663.267</b>	<b>0,77</b>		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>2.274.075</b>	<b>1,05</b>
<b>KANADA</b>				<b>IRLAND</b>			
31.159	Canadian National Railway Company	4.183.469	1,93	54.213	CRH plc	2.192.635	1,02
157.783	Manulife Financial Corp.	3.367.752	1,57	68.981	Experian plc	2.680.212	1,24
25.269	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	1.491.629	0,69	10.136	Linde plc	3.237.743	1,50
114.787	Suncor Energy Inc.	3.740.305	1,73	42.521	Medtronic Inc.	4.717.705	2,18
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>12.783.155</b>	<b>5,92</b>		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>12.828.295</b>	<b>5,94</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>JAPAN</b>			
23.494	Netease.com - ADR	2.107.177	0,98	12.100	Disco Corp.	3.429.373	1,60
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>2.107.177</b>	<b>0,98</b>	41.900	Rohm Company Limited	3.310.575	1,53
				237.800	Z Holdings Corp.	1.050.924	0,49
					<b>Japan, insgesamt</b>	<b>7.790.872</b>	<b>3,62</b>
<b>CHINA</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
417.292	Ping An Insurance Group Company of China Limited	2.965.278	1,37	24.644	Akzo Nobel NV	2.144.804	0,99
	<b>China, insgesamt</b>	<b>2.965.278</b>	<b>1,37</b>	44.613	Philips NV	1.376.480	0,64
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NORWEGEN</b>			
116.179	Tryg A/S	2.854.365	1,32	78.039	Equinor ASA	2.955.911	1,37
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>2.854.365</b>	<b>1,32</b>		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>2.955.911</b>	<b>1,37</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
40.592	BNP Paribas	2.345.402	1,09	99.088	Samsung Electronics Company Limited	5.689.978	2,64
66.723	Total SA	3.417.237	1,58		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>5.689.978</b>	<b>2,64</b>
16.410	Vinci SA	1.697.866	0,79				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>7.460.505</b>	<b>3,46</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SINGAPUR</b>			
197.601	Deutsche Telekom AG - Reg	3.722.682	1,73	41.800	DBS Group Holdings Limited	1.106.657	0,51
187.583	E.ON AG	2.200.265	1,02		<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>1.106.657</b>	<b>0,51</b>
75.946	Evonik Industries AG	2.127.743	0,99				
4.901	Muenchener Rueckversicherungs AG - Reg	1.325.103	0,61				
14.609	SAP SE	1.643.676	0,76				
31.244	Siemens AG - Reg	4.368.399	2,02				
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>15.387.868</b>	<b>7,13</b>				
				<b>SPANIEN</b>			
				121.825	Inditex SA	2.681.151	1,24
					<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>2.681.151</b>	<b>1,24</b>
				<b>SCHWEDEN</b>			
				83.562	Sandvik AB	1.802.257	0,83
					<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>1.802.257</b>	<b>0,83</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Equity Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>					
<b>SCHWEIZ</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>					
27.921	Novartis AG - Reg	2.465.179	1,14	22.208	Quest Diagnostics Inc.	3.039.387	1,41		
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>2.465.179</b>	<b>1,14</b>	16.446	Stanley Works	2.298.986	1,06		
<b>TAIWAN</b>				55.764	State Street Corp.	4.858.160	2,25		
74.000	MediaTek Inc.	2.337.387	1,08	54.839	Truist Financial Corp.	3.109.371	1,44		
187.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	3.896.424	1,80	13.459	United Parcel Service Inc.	2.886.417	1,34		
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>6.233.811</b>	<b>2,88</b>	39.969	Valero Energy Corp.	4.058.453	1,88		
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				55.231	Xcel Energy Inc.	3.986.022	1,85		
128.212	3i Group plc	2.343.931	1,09	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>97.657.567</b>	<b>45,24</b>	
92.083	Anglo American plc	4.816.302	2,23	<b>Aktien, insgesamt</b>			<b>212.306.235</b>	<b>98,33</b>	
1.534.470	BT Group plc	3.681.096	1,70	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>212.306.235</b>	<b>98,33</b>
44.717	Diageo plc	2.274.699	1,05	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>					
173.567	Glaxosmithkline plc	3.764.297	1,74	<b>Fonds</b>					
41.638	Reckitt Benckiser Group plc	3.197.258	1,48	<b>IRLAND</b>					
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>20.077.583</b>	<b>9,29</b>	2.254.362	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	2.254.362	1,04		
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Irland, insgesamt</b>				<b>2.254.362</b>	<b>1,04</b>
37.053	American Electric Power Company Inc.	3.696.778	1,71	<b>Fonds, insgesamt</b>				<b>2.254.362</b>	<b>1,04</b>
8.984	American Tower Corp.	2.256.960	1,05	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				<b>2.254.362</b>	<b>1,04</b>
18.506	Analog Devices Inc.	3.056.821	1,42	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				<b>214.560.597</b>	<b>99,37</b>
8.464	Anthem Inc.	4.157.686	1,92	<b>(Gesamtkosten: USD 197.267.230)</b>					
7.680	Automatic Data Processing Inc.	1.747.507	0,81	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>					
63.313	Bristol-Myers Squibb Company	4.623.747	2,15						
60.287	Coca Cola Company	3.737.794	1,74						
17.962	Crown Castle International Corp.	3.315.786	1,53						
57.115	Ebay Inc.	3.270.405	1,51						
12.096	Eli Lilly & Company	3.463.932	1,60						
25.066	Fidelity National Information Services Inc.	2.517.128	1,17						
93.624	General Motors Company	4.095.114	1,90						
4.943	Grainger (WWW) Inc.	2.549.550	1,18						
15.161	IBM Corp.	1.971.233	0,91						
32.445	IntercontinentalExchange Inc.	4.286.634	1,98						
14.260	Marsh & McLennan Companies Inc.	2.430.189	1,13						
13.511	McDonald's Corp.	3.341.000	1,55						
28.494	Microsoft Corp.	8.784.984	4,06						
13.296	NextEra Energy Inc.	1.126.304	0,52						
21.313	PepsiCo Inc.	3.567.370	1,65						
24.813	Procter & Gamble Company	3.791.426	1,76						
10.682	Qualcomm Inc.	1.632.423	0,76						

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Select

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>JAPAN</b>			
33.190	Sea Limited	3.975.830	0,65	15.700	Keyence Corp.	7.405.357	1,22
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>3.975.830</b>	<b>0,65</b>	111.700	Recruit Holdings Company Limited	4.982.442	0,82
<b>DÄNEMARK</b>				62.100	Sony Corp.	6.513.146	1,07
99.956	Novo Nordisk A/S	11.197.192	1,84	89.800	Yaskawa Electric Corp.	3.562.406	0,58
66.298	Orsted A/S	8.421.449	1,38		<b>Japan, insgesamt</b>	<b>22.463.351</b>	<b>3,69</b>
240.223	Tryg A/S	5.901.962	0,97	<b>NIEDERLANDE</b>			
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>25.520.603</b>	<b>4,19</b>	29.548	Airbus SE	3.628.260	0,60
<b>FINNLAND</b>				32.431	Koninklijke DSM NV	5.863.707	0,96
141.174	Upm-Kymmene Oyj	4.658.911	0,76		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>9.491.967</b>	<b>1,56</b>
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>4.658.911</b>	<b>0,76</b>	<b>NORWEGEN</b>			
<b>FRANKREICH</b>				197.661	Equinor ASA	7.486.876	1,23
44.806	Essilor International SA	8.290.620	1,36		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>7.486.876</b>	<b>1,23</b>
73.137	Schneider Electric SE	12.382.154	2,03	<b>SÜDKOREA</b>			
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>20.672.774</b>	<b>3,39</b>	270.102	Samsung Electronics Company Limited	15.510.197	2,55
<b>DEUTSCHLAND</b>				12.447	Samsung Sdi Company Limited	6.120.561	1,00
23.547	Adidas AG	5.551.689	0,91		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>21.630.758</b>	<b>3,55</b>
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>5.551.689</b>	<b>0,91</b>	<b>SCHWEIZ</b>			
<b>HONGKONG</b>				77.359	Nestle SA - Reg	10.104.374	1,66
430.000	AIA Group Limited	4.527.093	0,74	21.640	Roche Holding AG	8.617.198	1,41
	<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>4.527.093</b>	<b>0,74</b>		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>18.721.572</b>	<b>3,07</b>
<b>INDIEN</b>				<b>TAIWAN</b>			
445.457	HDFC Bank Limited	8.643.741	1,42	822.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	17.127.598	2,81
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>8.643.741</b>	<b>1,42</b>		<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>17.127.598</b>	<b>2,81</b>
<b>INDONESIEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
26.084.574	Bank Rakyat Indonesia	8.463.813	1,39	148.676	Diageo plc	7.562.966	1,24
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>8.463.813</b>	<b>1,39</b>	255.122	SSE PLC	5.873.323	0,96
<b>IRLAND</b>					<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>13.436.289</b>	<b>2,20</b>
169.891	CRH plc	6.871.212	1,13	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
100.846	Medtronic Inc.	11.188.863	1,83	49.524	Abbott Laboratories	5.861.661	0,96
49.327	Trane Technologies plc	7.532.233	1,24	25.871	Adobe Systems Inc.	11.787.345	1,94
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>25.592.308</b>	<b>4,20</b>	12.016	Alphabet Inc. - A	33.420.702	5,49

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Select

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>IRLAND</b>			
9.038	Amazon.com Inc.	29.463.428	4,84	10.502.135	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	10.502.135	1,72
25.098	American Tower Corp.	6.305.120	1,04		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.502.135</b>	<b>1,72</b>
34.886	Autodesk Inc.	7.477.814	1,23		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>10.502.135</b>	<b>1,72</b>
114.357	Centene Corp.	9.627.716	1,58		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>10.502.135</b>	<b>1,72</b>
17.304	Cooper Companies Inc.	7.225.977	1,19		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>592.254.382</b>	<b>97,22</b>
28.060	Deere & Company	11.657.808	1,91		<b>(Gesamtkosten: USD 484.642.700)</b>		
48.223	Doximity Inc.	2.511.936	0,41				
31.775	Ecolab Inc.	5.610.194	0,92				
61.593	Electronic Arts Inc.	7.792.130	1,28				
29.260	Eli Lilly & Company	8.379.186	1,38				
8.133	Equinix Inc.	6.031.595	0,99				
35.578	Fidelity National Information Services Inc.	3.572.743	0,59				
143.410	General Motors Company	6.272.753	1,03				
31.155	IntercontinentalExchange Inc.	4.116.199	0,68				
24.175	Intuit Inc.	11.624.307	1,91				
83.189	JPMorgan Chase & Company	11.340.324	1,86				
17.312	Lam Research Corp.	9.307.104	1,53				
48.428	Mastercard Inc. - A	17.307.199	2,84				
4.502	Mercadolibre Inc.	5.355.039	0,88				
122.738	Microsoft Corp.	37.841.354	6,20				
72.335	NextEra Energy Inc.	6.127.498	1,01				
42.721	Nvidia Corp.	11.656.852	1,91				
47.891	Paypal Holdings Inc.	5.538.594	0,91				
67.888	Qualcomm Inc.	10.374.644	1,70				
10.686	S&P Global Inc.	4.383.183	0,72				
31.893	Stryker Corp.	8.526.594	1,40				
16.560	Thermo Fisher Scientific Inc.	9.781.164	1,61				
107.208	T-Mobile USA Inc.	13.760.147	2,26				
51.769	Transunion	5.349.808	0,88				
63.445	Trimble Navigation Limited	4.576.922	0,75				
159.240	Uber Technologies Inc.	5.681.683	0,93				
30.538	Union Pacific Corp.	8.343.287	1,37				
71.428	Walt Disney Company	9.797.064	1,61				
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>363.787.074</b>	<b>59,74</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>581.752.247</b>	<b>95,50</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>581.752.247</b>	<b>95,50</b>				

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>BELGIEN</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>				
2.076	Lotus Bakeries NV	9.861.000	0,52	2.032.176	Stevanato Group SpA	36.747.747	1,94	
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>9.861.000</b>	<b>0,52</b>		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>48.816.768</b>	<b>2,58</b>	
<b>KANADA</b>				<b>JAPAN</b>				
312.250	Cargojet Inc.	42.707.114	2,26	1.322.700	Capcom Company Limited	29.069.495	1,54	
393.541	Dye & Durham Limited	7.274.706	0,38	106.095	Disco Corp.	27.024.994	1,43	
755.173	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	40.064.587	2,11	623.909	Giken Limited	17.162.965	0,91	
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>90.046.407</b>	<b>4,75</b>	316.735	Jtower Inc.	16.980.359	0,90	
				1.953.700	Mani Inc.	21.237.147	1,12	
<b>KAIMANINSELN</b>					491.262	Menicon Company Limited	10.683.889	0,56
2.534.414	Diversey Holdings Limited	17.243.081	0,91	517.020	Shoei Company Limited	17.553.306	0,93	
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>17.243.081</b>	<b>0,91</b>	882.400	SMS Company Limited	22.182.859	1,17	
				752.010	Square Enix Holdings Company Limited	30.236.790	1,60	
<b>DÄNEMARK</b>					<b>Japan, insgesamt</b>	<b>192.131.804</b>	<b>10,16</b>	
544.080	Alk-Abello A/S	10.930.688	0,58	<b>SPANIEN</b>				
152.619	Simcorp A/S	10.197.245	0,54	675.900	Fluidra SA	17.776.170	0,94	
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>21.127.933</b>	<b>1,12</b>		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>17.776.170</b>	<b>0,94</b>	
<b>FINNLAND</b>				<b>SCHWEDEN</b>				
318.336	Musti Group Oyj	7.627.331	0,40	674.903	Avanza Bank Holding AB	15.751.068	0,83	
208.441	Revenio Group Oyj	9.967.649	0,53	2.077.540	Fortnox AB	10.408.502	0,55	
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>17.594.980</b>	<b>0,93</b>	781.923	Hemnet Group AB	10.715.473	0,57	
<b>FRANKREICH</b>					111.886	MIPS AB	9.495.366	0,50
335.964	Lectra	14.480.048	0,77	383.108	Thule Group AB	13.854.976	0,73	
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>14.480.048</b>	<b>0,77</b>		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>60.225.385</b>	<b>3,18</b>	
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SCHWEIZ</b>				
246.607	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	13.662.028	0,72	58.041	Belimo Holding AG	27.917.507	1,47	
181.130	CTS Eventim AG	11.233.683	0,59	17.159	Inficon Holding AG	17.830.729	0,94	
35.692	Hypoport AG	12.292.325	0,65	1.992	LEM Holding SA	4.357.856	0,23	
103.712	Stratec Biomedical AG	10.495.654	0,55	1.778.354	SIG Combibloc Group AG	40.641.486	2,15	
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>47.683.690</b>	<b>2,51</b>	53.653	Tecan Group AG - Reg	19.283.121	1,02	
<b>ISLAND</b>					<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>110.030.699</b>	<b>5,81</b>	
1.664.113	Marel HF	8.819.799	0,47	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				
	<b>Island, insgesamt</b>	<b>8.819.799</b>	<b>0,47</b>	2.005.963	Abcam plc	32.876.416	1,74	
<b>ITALIEN</b>				1.071.359	Auction Technology Group plc	12.449.682	0,65	
85.053	Diasorin SpA	12.069.021	0,64	5.204.611	Dr. Martens plc	14.707.348	0,78	
				365.852	Future plc	11.264.826	0,60	
				290.029	Games Workshop Group plc	24.933.820	1,32	
				430.307	Genus plc	14.369.683	0,76	
				325.026	Keywords Studios plc	10.076.998	0,53	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
405.354	Renishaw plc	18.563.386	0,98	428.203	Triumph Bancorp Inc.	36.183.567	1,91
1.380.472	Watches of Switzerland Group plc	18.622.768	0,98	702.658	Verra Mobility Corp.	10.281.106	0,54
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>157.864.927</b>	<b>8,34</b>	251.615	Visteon Corp.	24.678.690	1,30
				113.817	WD-40 Company	18.743.261	0,99
				1.275.232	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	44.847.731	2,37
				352.885	Workiva Inc.	37.424.555	1,98
				268.327	XPEL Inc.	12.687.443	0,67
				498.781	Yeti Holdings Inc.	26.887.956	1,43
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.025.345.332</b>	<b>54,17</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>1.839.048.023</b>	<b>97,16</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.839.048.023</b>	<b>97,16</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>		
					<b>Fonds</b>		
					<b>IRLAND</b>		
				42.329.206	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	38.043.595	2,01
					<b>Irland, insgesamt</b>	<b>38.043.595</b>	<b>2,01</b>
					<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>38.043.595</b>	<b>2,01</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>38.043.595</b>	<b>2,01</b>
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.877.091.618</b>	<b>99,17</b>
					<b>(Gesamtkosten: EUR 1.879.484.054)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
3.512	Shopify Inc. - A	2.373.972	0,19	206.404	Microsoft Corp.	63.636.416	5,13
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>2.373.972</b>	<b>0,19</b>	113.809	Mirati Therapeutics Inc.	9.357.376	0,75
				239.602	Northern Trust Corp.	27.901.653	2,25
				891.961	Nov Inc.	17.491.355	1,41
				43.831	Nvidia Corp.	11.959.727	0,96
				122.988	Qualcomm Inc.	18.795.026	1,51
				91.578	Republic Services Inc.	12.134.085	0,98
				93.392	Salesforce.com Inc.	19.828.989	1,60
				5.205	Servicenow Inc.	2.898.612	0,23
				349.536	State Street Corp.	30.451.576	2,45
				21.736	Svb Financial Group	12.160.205	0,98
				264.916	Take-Two Interactive Software Inc.	40.728.186	3,28
				180.488	Target Corp.	38.303.164	3,09
				166.663	Teradata Corp.	8.214.819	0,66
				27.609	Teradyne Inc.	3.264.212	0,26
				211.828	Tjx Companies Inc.	12.832.540	1,03
				83.052	Transunion	8.582.594	0,69
				45.459	Trimble Navigation Limited	3.279.412	0,26
				68.700	Union Pacific Corp.	18.769.527	1,51
				179.364	United Parcel Service Inc.	38.466.403	3,10
				155.949	Vertex Pharmaceuticals Inc.	40.698.011	3,28
				493.708	Virtu Financial Inc.	18.375.812	1,48
				419.223	Voya Financial Inc.	27.815.446	2,24
				12.292	Zebra Technologies Corp.	5.085.200	0,41
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>1.152.544.062</b>	<b>92,85</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>1.199.288.793</b>	<b>96,61</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.199.288.793</b>	<b>96,61</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>		
					<b>Fonds</b>		
					<b>IRLAND</b>		
				34.016.617	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	34.016.617	2,74
					<b>Irland, insgesamt</b>	<b>34.016.617</b>	<b>2,74</b>
					<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>34.016.617</b>	<b>2,74</b>
					<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>34.016.617</b>	<b>2,74</b>
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.233.305.410</b>	<b>99,35</b>
					<b>(Gesamtkosten: USD 1.025.881.727)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Select

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
3.578	Shopify Inc. - A	2.418.585	0,58	102.475	United Parcel Service Inc.	21.976.788	5,31
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>2.418.585</b>	<b>0,58</b>	66.455	Vertex Pharmaceuticals Inc.	17.342.761	4,19
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			
84.752	Globalfoundries Inc.	5.290.220	1,28			<b>398.297.568</b>	<b>96,28</b>
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>5.290.220</b>	<b>1,28</b>				
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Aktien, insgesamt</b>			
35.287	Adobe Systems Inc.	16.077.463	3,89			<b>406.006.373</b>	<b>98,14</b>
49.336	Agco Corp.	7.204.536	1,74	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
9.070	Alphabet Inc. - A	25.226.845	6,10			<b>406.006.373</b>	<b>98,14</b>
79.432	American Electric Power Company Inc.	7.924.931	1,92	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
9.593	Block Inc.	1.300.811	0,31			<b>406.006.373</b>	<b>98,14</b>
359.939	Cisco Systems Inc.	20.070.199	4,85	<b>(Gesamtkosten: USD 381.355.682)</b>			
312.934	Coca Cola Company	19.401.908	4,69	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
45.356	Crowdstrike Holdings Inc. - A	10.299.440	2,49				
207.466	CVS Health Corp.	20.997.634	5,07				
39.774	Darling International Inc.	3.197.034	0,77				
33.905	Doordash Inc. - A	3.973.327	0,96				
64.132	Doximity Inc.	3.340.636	0,81				
149.216	Electronic Arts Inc.	18.877.316	4,56				
53.261	Exact Sciences Corp.	3.724.009	0,90				
151.604	General Motors Company	6.631.159	1,60				
116.083	Hilton Worldwide Holdings Inc.	17.614.434	4,26				
185.602	Konitoor Brands Inc.	7.674.643	1,86				
31.384	Lam Research Corp.	16.872.352	4,08				
66.701	Lamb Weston Holding Inc.	3.996.057	0,97				
222.564	Livent Corp.	5.802.243	1,40				
20.941	Mastercard Inc. - A	7.483.894	1,81				
63.149	Microsoft Corp.	19.469.469	4,71				
40.561	Mirati Therapeutics Inc.	3.334.925	0,81				
112.303	Ncino Inc.	4.602.177	1,11				
87.521	Northern Trust Corp.	10.191.820	2,46				
439.259	Nov Inc.	8.613.869	2,08				
73.160	Salesforce.com Inc.	15.533.331	3,75				
97.693	Schnitzer Steel Industries Inc.	5.074.174	1,23				
43.396	Starbucks Corp.	3.947.734	0,95				
237.506	State Street Corp.	20.691.523	5,01				
78.417	Target Corp.	16.641.656	4,03				
101.855	Teradata Corp.	5.020.433	1,21				
70.899	Transunion	7.326.703	1,77				
39.674	Union Pacific Corp.	10.839.334	2,62				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BAHAMAS</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
233.174	OneSpaWorld Holdings Limited	2.378.375	0,71	39.950	Icf International Inc.	3.760.893	1,12
	<b>Bahamas, insgesamt</b>	<b>2.378.375</b>	<b>0,71</b>	62.352	Insmed Inc.	1.465.272	0,44
<b>BERMUDAS</b>				197.164	Kontoor Brands Inc.	8.152.732	2,43
124.891	Axalta Coating System Limited	3.069.821	0,91	114.508	Lamb Weston Holding Inc.	6.860.174	2,04
141.735	Essent Group Limited	5.840.899	1,74	304.439	Livent Corp.	7.936.725	2,36
	<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>8.910.720</b>	<b>2,65</b>	86.563	Madison Square Garden Entertainment Corp.	7.211.564	2,14
<b>KANADA</b>				224.212	Matthews International Corp. - A	7.255.500	2,15
90.057	Gildan Activewear Inc.	3.375.336	1,00	19.885	Medpace Holdings Inc.	3.252.987	0,97
60.996	Ritchie Bros Auctioneers Inc.	3.600.594	1,07	42.565	Mirati Therapeutics Inc.	3.499.694	1,04
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>6.975.930</b>	<b>2,07</b>	156.646	Moelis & Company - A	7.354.530	2,18
<b>IRLAND</b>				25.282	MSA Safety Inc.	3.354.921	1,00
64.037	Trinseo plc	3.068.653	0,91	261.206	Natus Medical Inc.	6.864.494	2,04
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.068.653</b>	<b>0,91</b>	129.900	Ncino Inc.	5.323.302	1,58
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				3.097.235	Newpark Resources	11.335.880	3,37
83.510	Acadia Pharmaceuticals Inc.	2.022.612	0,60	205.987	Nov Inc.	4.039.405	1,20
35.232	Acushnet Holdings Corp.	1.418.440	0,42	79.447	Patterson Companies Inc.	2.571.699	0,76
92.015	Aerie Pharmaceuticals Inc.	837.337	0,25	18.812	Qualys Inc.	2.679.017	0,80
62.262	Agco Corp.	9.092.120	2,71	202.301	Quanex Building Products Corp.	4.246.298	1,26
148.938	Allogene Therapeutics Inc.	1.356.825	0,40	39.672	Quanterix Corp.	1.158.026	0,34
48.946	Aspen Technology Inc.	8.094.200	2,41	130.484	Ranpak Holdings Corp.	2.665.788	0,79
369.133	Avaya Holdings Corp.	4.676.915	1,39	770.188	Regis Corp.	1.632.799	0,49
258.338	Avista Corp.	11.663.961	3,47	105.854	Revolution Medicines Inc.	2.700.336	0,81
119.339	Axos Financial Inc.	5.536.136	1,65	56.364	Sage Therapeutics Inc.	1.865.648	0,55
120.431	Bloom Energy Corp.	2.908.409	0,86	184.001	Schnitzer Steel Industries Inc.	9.557.012	2,84
36.512	Bright Horizons Family Solutions Inc.	4.844.777	1,44	210.226	Teradata Corp.	10.362.040	3,08
268.775	Carriage Services Inc.	14.333.771	4,27	7.880	Teradyne Inc.	931.652	0,28
39.971	Cirrus Logic Inc.	3.389.141	1,00	40.966	Toast Inc.	890.191	0,26
86.067	Conmed Corp.	12.785.253	3,81	195.773	Utz Brands Inc.	2.893.525	0,86
48.002	Darling International Inc.	3.858.401	1,15	403.266	Virtu Financial Inc.	15.009.560	4,47
31.754	Doximity Inc.	1.654.066	0,49	131.196	Voya Financial Inc.	8.704.855	2,58
354.892	Empire State Realty Trust Inc. - A	3.485.039	1,04	135.793	Wendy's Company	2.983.373	0,88
112.688	Endeavor Group Holdings Inc.	3.326.550	0,99	321.617	WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	12.584.873	3,74
70.014	Envestnet Inc.	5.211.842	1,55	41.855	Wingstop Inc.	4.911.684	1,46
279.617	Evo Payments Inc.	6.456.357	1,92	209.733	Xponential Fitness Inc.	4.916.141	1,46
38.461	Fti Consulting Inc.	6.046.838	1,80	26.323	Zendesk Inc.	3.166.394	0,94
109.793	Gap Inc.	1.545.885	0,46		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>309.663.708</b>	<b>92,06</b>
15.158	Herc Holdings Inc.	2.532.750	0,75		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>330.997.386</b>	<b>98,40</b>
96.664	Houlihan Lokey Inc.	8.487.099	2,52		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>330.997.386</b>	<b>98,40</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
3.515.198	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.515.198	1,05
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.515.198</b>	<b>1,05</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>3.515.198</b>	<b>1,05</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>3.515.198</b>	<b>1,05</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>334.512.584</b>	<b>99,45</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 291.630.422)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.



## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

## Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>HONGKONG (Fortsetzung)</b>			
119.494	Amcor plc	1.373.828	1,44	507.000	Boc Hong Kong Holdings Limited	1.922.758	2,01
42.839	Aristocrat Leisure Limited	1.180.637	1,23	198.400	Galaxy Entertainment Group Limited	1.190.693	1,25
180.443	Australia & New Zealand Banking Group Limited	3.739.900	3,91	834.000	Guangdong Investment Limited	1.141.619	1,19
4.220	CSL Limited	849.770	0,89	69.121	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	3.278.025	3,42
130.833	Lendlease Group	1.100.389	1,15	245.600	Hua Hong Semiconductor Limited	1.044.318	1,09
23.713	Macquarie Group Limited	3.619.685	3,79	30.500	Techtronic Industries Company Limited	494.222	0,52
94.398	Newcrest Mining Limited	1.895.550	1,98		<b>Hongkong, insgesamt</b>	<b>13.025.998</b>	<b>13,62</b>
18.472	Rio Tinto Limited	1.652.240	1,73				
417.446	Santos Limited	2.426.344	2,54				
124.211	Transurban Group	1.263.893	1,32				
	<b>Australien, insgesamt</b>	<b>19.102.236</b>	<b>19,98</b>				
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>INDIEN</b>			
164.316	Alibaba Group Holding Limited	2.352.046	2,46	43.823	HDFC Bank Limited	850.351	0,89
82.600	Baidu Inc. - A	1.492.440	1,56	97.800	Reliance Industries Limited	3.400.583	3,55
206.000	China Mengniu Dairy Company Limited	1.110.044	1,16	12.529	Tata Consultancy Services Limited	618.383	0,65
56.788	JD.com Inc. - A	1.696.808	1,77	80.594	Tech Mahindra Limited	1.594.813	1,67
53.100	Meituan Dianping - B	1.055.029	1,10	125.759	UPL Limited	1.277.260	1,34
68.100	NetEase Inc.	1.250.450	1,31		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>7.741.390</b>	<b>8,10</b>
5.777	Sea Limited	692.027	0,72				
77.200	Shenzhou International Group Holdings Limited	1.033.092	1,08		<b>INDONESIEN</b>		
87.100	Tencent Holdings Limited	4.161.810	4,35	2.405.200	Indofood Cbp Sukses Makmur Tbk Pt	1.230.934	1,29
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>14.843.746</b>	<b>15,51</b>		<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.230.934</b>	<b>1,29</b>
<b>CHINA</b>				<b>SÜDKOREA</b>			
498.500	A-Living Services Company Limited - H	697.647	0,73	48.557	Hana Financial Group Inc.	1.947.011	2,03
1.113.600	China Construction Bank Corp.	837.539	0,88	115.764	Hanon Systems	1.127.031	1,18
26.200	China International Travel Service Corp. Limited - A	678.389	0,71	16.895	Kia Corp.	1.031.502	1,08
160.800	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	934.436	0,98	39.915	Mando Corp.	1.656.473	1,73
115.700	Midea Group Company Limited - A	1.038.875	1,09	4.911	Naver Corp.	1.379.645	1,44
239.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	1.701.888	1,78	10.966	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	1.492.837	1,56
26.900	Wuliangye Yibin Company Limited - A	657.063	0,69	123.944	Samsung Electronics Company Limited	7.117.296	7,44
	<b>China, insgesamt</b>	<b>6.545.837</b>	<b>6,86</b>	2.549	Samsung Sdi Company Limited	1.253.419	1,31
<b>HONGKONG</b>					<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>17.005.214</b>	<b>17,77</b>
375.600	AIA Group Limited	3.954.363	4,14				
					<b>SINGAPUR</b>		
				1.072.900	Digital Core REIT Management Pte Limited	1.190.919	1,25
				123.300	Oversea-Chinese Banking Corp. Limited	1.127.908	1,18
					<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>2.318.827</b>	<b>2,43</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>TAIWAN</b>			
491.000	Powertech Technology Inc.	1.628.004	1,70
422.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	8.793.001	9,20
118.000	Yageo Corp.	1.787.401	1,87
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>12.208.406</b>	<b>12,77</b>
<b>THAILAND</b>			
2.421.500	Thai Beverage plc	1.279.323	1,34
	<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>1.279.323</b>	<b>1,34</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>95.301.911</b>	<b>99,67</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>95.301.911</b>	<b>99,67</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

#### Fonds

#### IRLAND

18.113	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	18.113	0,02
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>18.113</b>	<b>0,02</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>18.113</b>	<b>0,02</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>18.113</b>	<b>0,02</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>95.320.024</b>	<b>99,69</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 84.527.799)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>HONGKONG (Fortsetzung)</b>				
152.986	Amcor plc	1.758.887	1,24	415.000	Galaxy Entertainment Group Limited	2.490.613	1,75	
52.132	Aristocrat Leisure Limited	1.436.751	1,01	54.937	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	2.605.356	1,83	
230.149	Australia & New Zealand Banking Group Limited	4.770.118	3,34	148.000	Sun Hung Kai Properties Limited	1.768.878	1,24	
267.526	Chalice Mining Limited	1.420.353	1,00	146.161	Techtronic Industries Company	2.368.391	1,66	
13.819	CSL Limited	2.782.693	1,96	<b>Hongkong, insgesamt</b>			<b>13.541.346</b>	<b>9,51</b>
752.073	Deterra Royalties Limited	2.727.835	1,92	<b>INDIEN</b>				
166.693	IGO Limited	1.760.004	1,24	282.452	Bharti Airtel Limited	2.814.091	1,98	
34.210	Macquarie Group Limited	5.222.007	3,67	33.535	Bharti Airtel Limited	175.232	0,12	
71.136	Oz Minerals Limited	1.424.700	1,00	177.390	HDFC Bank Limited	3.442.113	2,42	
549.563	Santos Limited	3.194.254	2,24	456.904	Hindalco Industries Limited	3.433.950	2,41	
207.326	Transurban Group	2.109.619	1,48	129.793	Reliance Industries Limited	4.513.006	3,17	
<b>Australien, insgesamt</b>			<b>20,10</b>	128.415	Tech Mahindra Limited	2.541.107	1,79	
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Indien, insgesamt</b>				
122.828	Alibaba Group Holding Limited	1.758.180	1,23	<b>INDONESIEN</b>			<b>16.919.499</b>	<b>11,89</b>
96.900	Baidu Inc. - A	1.750.816	1,23	10.235.456	Bank Rakyat Indonesia	3.321.158	2,33	
392.000	China Mengniu Dairy Company Limited	2.112.316	1,48	6.867.300	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	2.190.019	1,54	
456.816	China Resources Land Limited	2.129.092	1,50	<b>Indonesien, insgesamt</b>			<b>5.511.177</b>	<b>3,87</b>
128.885	JD.com Inc. - A	3.851.044	2,70	<b>PHILIPPINEN</b>				
348.000	Kingdee International Software Group Company Limited	774.083	0,54	1.326.090	Ayala Land Inc.	898.262	0,63	
78.483	Meituan Dianping - B	1.559.357	1,10	1.079.265	Metropolitan Bank & Trust	1.188.899	0,84	
25.000	Parade Technologies Limited	1.579.316	1,11	<b>Philippinen, insgesamt</b>			<b>2.087.161</b>	<b>1,47</b>
12.748	Sea Limited	1.527.083	1,07	<b>SÜDKOREA</b>				
109.600	Shenzhen International Group Holdings Limited	1.466.669	1,03	75.955	Hanon Systems	739.467	0,52	
139.900	Tencent Holdings Limited	6.684.698	4,69	18.093	Kia Corp.	1.104.645	0,78	
107.000	Wuxi Biologics Cayman Inc.	888.774	0,62	28.885	Mando Corp.	1.198.728	0,84	
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>			<b>18,30</b>	7.658	Naver Corp.	2.151.358	1,51	
<b>CHINA</b>				2.401	Samsung Biologics Company Limited	1.638.242	1,15	
500.500	China Merchants Bank Company Limited - H	3.933.620	2,76	14.280	Samsung Electro-Mechanics Company Limited	1.943.983	1,37	
153.000	Country Garden Services Holdings	656.434	0,46	134.261	Samsung Electronics Company Limited	7.709.734	5,41	
32.477	Wuliangye Yibin Company Limited - A	793.288	0,56	3.386	Samsung Sdi Company Limited	1.664.997	1,17	
76.200	WuXi AppTec Company Limited - H	1.211.392	0,85	<b>Südkorea, insgesamt</b>			<b>18.151.154</b>	<b>12,75</b>
<b>China, insgesamt</b>			<b>4,63</b>	<b>HONGKONG</b>				
409.200	AIA Group Limited	4.308.108	3,03					

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asia Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>SINGAPUR</b>			
1.773.000	Digital Core REIT Management Pte Limited	1.968.030	1,38
672.600	Keppel Corp. Limited	3.190.668	2,24
149.100	United Overseas Bank Limited	3.527.677	2,48
	<b>Singapur, insgesamt</b>	<b>8.686.375</b>	<b>6,10</b>
<b>TAIWAN</b>			
13.000	Asmedia Technology Inc.	882.497	0,62
262.000	Chailease Holding Company Limited	2.318.086	1,63
291.000	Chroma ATE Inc.	1.828.167	1,28
30.000	MediaTek Inc.	947.589	0,67
586.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	12.210.184	8,57
	<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>18.186.523</b>	<b>12,77</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>144.366.618</b>	<b>101,39</b>
<b>Rechte</b>			
<b>SÜDKOREA</b>			
155	Samsung Biologics Company Limited Right	25.449	0,02
	<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>25.449</b>	<b>0,02</b>
	<b>Rechte, insgesamt</b>	<b>25.449</b>	<b>0,02</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>144.392.067</b>	<b>101,41</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
8.554	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	8.554	0,01
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>8.554</b>	<b>0,01</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>8.554</b>	<b>0,01</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>8.554</b>	<b>0,01</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>144.400.621</b>	<b>101,42</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 126.422.983)</b>			

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
59.462	Canadian Natural Resources Limited	3.685.455	0,97	48.687	Endeavor Group Holdings Inc.	1.437.240	0,38
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>3.685.455</b>	<b>0,97</b>	33.443	EOG Resources Inc.	3.987.409	1,05
				9.602	Fidelity National Information Services Inc.	964.233	0,25
<b>KAIMANINSELN</b>				18.144	Global Payments Inc.	2.482.825	0,65
14.162	Globalfoundries Inc.	883.992	0,23	23.746	Honeywell International Inc.	4.620.497	1,22
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>883.992</b>	<b>0,23</b>	17.594	IBM Corp.	2.287.572	0,60
<b>IRLAND</b>				27.702	International Flavors & Fragrances Inc.	3.638.104	0,95
2.837	Aon plc	923.812	0,24	11.151	Intuit Inc.	5.361.846	1,42
56.435	Medtronic Inc.	6.261.463	1,65	60.297	Johnson & Johnson	10.686.437	2,82
12.244	Willis Towers Watson plc	2.892.278	0,76	31.070	JPMorgan Chase & Company	4.235.462	1,12
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>10.077.553</b>	<b>2,65</b>	7.715	Lam Research Corp.	4.147.661	1,09
<b>SCHWEIZ</b>				8.977	Lowe's Companies Inc.	1.815.060	0,48
41.266	TE Connectivity Limited	5.405.020	1,42	24.809	Marvell Technology Inc.	1.779.053	0,47
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>5.405.020</b>	<b>1,42</b>	17.355	Mastercard Inc. - A	6.202.330	1,64
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				7.934	McDonald's Corp.	1.961.920	0,52
26.607	Abbott Laboratories	3.149.205	0,83	24.115	Meta Platforms Inc.	5.362.211	1,41
10.945	Adobe Systems Inc.	4.986.761	1,32	24.648	Micron Technology Inc.	1.919.833	0,51
19.369	Akamai Technologies Inc.	2.312.465	0,61	83.783	Microsoft Corp.	25.831.136	6,82
3.640	Alphabet Inc. - A	10.124.114	2,67	58.826	Mondelez International Inc.	3.693.096	0,97
3.861	Alphabet Inc. - C	10.783.734	2,84	21.634	Monster Beverage Corp.	1.728.557	0,46
5.626	Amazon.com Inc.	18.340.479	4,85	4.482	MSCI Inc. - A	2.253.908	0,59
52.741	American Electric Power Company Inc.	5.261.970	1,38	5.551	NetFlix Inc.	2.079.349	0,55
7.103	American Express Company	1.328.261	0,35	16.059	Newmont Mining Corp.	1.275.888	0,34
17.456	American Tower Corp.	4.385.296	1,16	18.892	Nutrien Limited	1.964.579	0,52
9.391	Anthem Inc.	4.613.047	1,22	18.758	Nvidia Corp.	5.118.308	1,35
142.637	Apple Inc.	24.905.846	6,57	10.441	Palo Alto Networks Inc.	6.499.627	1,71
166.692	Bank of America Corp.	6.871.045	1,81	25.379	Paypal Holdings Inc.	2.935.081	0,77
22.735	Baxter International Inc.	1.762.872	0,47	59.881	Public Service Enterprise Group Inc.	4.191.670	1,11
30.458	Berkshire Hathaway Inc.	10.748.933	2,84	122.032	Raytheon Technologies Corp.	12.089.710	3,19
19.307	BioMarin Pharmaceuticals Inc.	1.488.570	0,39	9.649	Salesforce.com Inc.	2.048.676	0,54
4.690	BlackRock Inc.	3.583.957	0,95	33.815	Snap Inc. - A	1.217.002	0,32
23.258	Carrier Global Corp.	1.066.844	0,28	106.931	Southwest Airlines Company	4.897.440	1,30
46.688	Chevron Corp.	7.602.207	2,01	64.295	State Street Corp.	5.601.380	1,48
775	Chipotle Mexican Grill Inc.	1.226.073	0,32	83.082	Sysco Corp.	6.783.646	1,79
80.145	Comcast Corp.	3.752.389	0,99	30.828	Take-Two Interactive Software Inc.	4.739.497	1,25
65.548	Corteva Inc.	3.767.699	0,99	85.926	Tapestry Inc.	3.192.151	0,84
51.989	CVS Health Corp.	5.261.807	1,39	3.320	Tesla Motors Inc.	3.577.632	0,94
72.069	Ebay Inc.	4.126.671	1,09	41.134	T-Mobile USA Inc.	5.279.549	1,39
12.166	Ecolab Inc.	2.148.029	0,57	144.006	Uber Technologies Inc.	5.138.134	1,36
21.921	Eli Lilly & Company	6.277.517	1,66	88.627	Under Armour Inc.	1.508.432	0,40
				16.139	Union Pacific Corp.	4.409.336	1,16
				17.364	Vertex Pharmaceuticals Inc.	4.531.483	1,20
				16.182	Visa Inc. - A	3.588.683	0,95
				47.278	Walmart Inc.	7.040.639	1,85

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
24.120	Walt Disney Company	3.308.299	0,87
26.039	Zillow Group - C	1.283.462	0,34
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>350.571.834</b>	<b>92,50</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>370.623.854</b>	<b>97,77</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>370.623.854</b>	<b>97,77</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>370.623.854</b>	<b>97,77</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 260.214.404)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>IRLAND</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
2.308	Accenture plc	778.327	0,99	8.098	Meta Platforms Inc.	1.800.671	2,29
591	Aon plc	192.447	0,24	7.457	Metlife Inc.	524.078	0,67
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>970.774</b>	<b>1,23</b>	16.269	Microsoft Corp.	5.015.896	6,38
				790	Molina Healthcare Inc.	263.536	0,34
				8.227	Morgan Stanley	719.040	0,91
				2.153	Norfolk Southern Corp.	614.079	0,78
				19.418	NRG Energy Inc.	744.874	0,94
				5.721	Nucor Corp.	850.427	1,08
				1.623	O'Reilly Automotive Inc.	1.111.690	1,41
				5.521	Otis Worldwide Corp.	424.841	0,54
				37.752	Pfizer Inc.	1.954.421	2,47
				6.391	Philip Morris International Inc.	600.371	0,76
				9.359	Procter & Gamble Company	1.430.055	1,82
				2.017	Public Storage Inc.	787.195	1,00
				15.170	Pulte Homes Inc.	635.623	0,81
				9.113	Qualcomm Inc.	1.392.648	1,77
				975	Ralph Lauren Corp.	110.604	0,14
				426	Regeneron Pharmaceuticals Inc.	297.527	0,38
				999	Republic Services Inc.	132.368	0,17
				2.580	Robert Half International Inc.	294.584	0,37
				272	S&P Global Inc.	111.569	0,14
				1.644	Simon Property Group Inc.	216.285	0,27
				3.987	Snap-On Inc.	819.249	1,04
				1.753	Southwest Airlines Company	80.287	0,11
				2.139	Starbucks Corp.	194.585	0,25
				1.855	T Rowe Price Group Inc.	280.457	0,36
				9.933	Tapestry Inc.	369.011	0,47
				1.058	Target Corp.	224.529	0,29
				597	Tesla Motors Inc.	643.327	0,82
				13.934	Textron Inc.	1.036.411	1,32
				12.782	Tyson Foods Inc. - A	1.145.651	1,46
				53.844	Under Armour Inc.	916.425	1,17
				5.517	United Parcel Service Inc.	1.183.176	1,50
				2.521	VeriSign Inc.	560.822	0,71
				1.752	Vertex Pharmaceuticals Inc.	457.218	0,58
				3.058	Voya Financial Inc.	202.898	0,26
				28.702	Wells Fargo & Company	1.390.899	1,76
				36.993	Weyerhaeuser Company	1.402.034	1,79
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>77.107.363</b>	<b>98,02</b>
					<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>78.078.137</b>	<b>99,25</b>
					<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>78.078.137</b>	<b>99,25</b>
					<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>78.078.137</b>	<b>99,25</b>
					<b>(Gesamtkosten: USD 71.570.889)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

## Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>ITALIEN (Fortsetzung)</b>			
87.604	KBC Group NV	5.727.550	1,21	365.112	UniCredit SpA	3.598.179	0,76
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>5.727.550</b>	<b>1,21</b>		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>13.497.429</b>	<b>2,84</b>
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
25.757	DSV A/S	4.503.223	0,95	17.130	ASM International NV	5.688.873	1,20
169.825	Novo Nordisk A/S	17.097.921	3,60	24.395	ASML Holding NV	14.880.950	3,13
250.929	Tryg A/S	5.540.821	1,17	604.145	ING Groep NV	5.746.023	1,21
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>27.141.965</b>	<b>5,72</b>	130.344	STMicroelectronics NV	5.162.926	1,09
					<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>31.478.772</b>	<b>6,63</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>NORWEGEN</b>			
293.814	AXA SA	7.805.169	1,64	577.225	DNB Bank ASA	11.871.975	2,49
179.795	BNP Paribas	9.336.754	1,97	278.052	Equinor ASA	9.465.578	1,99
105.293	Compagnie de Saint-Gobain	5.714.251	1,20		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>21.337.553</b>	<b>4,48</b>
107.511	Dassault Systemes SE	4.807.354	1,01				
7.964	Kering	4.584.875	0,97				
35.215	L'Oreal SA	12.812.978	2,70				
26.156	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	16.985.707	3,58				
144.728	Publicis Groupe SA	7.997.669	1,68				
49.396	Schneider Electric SE	7.516.095	1,58				
31.804	Teleperformance	11.013.725	2,32				
305.244	Total SA	14.050.381	2,96				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>102.624.958</b>	<b>21,61</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
44.282	Allianz SE - Reg	9.589.267	2,02	130.193	Atlas Copco AB - A	6.173.638	1,30
104.244	Brenntag AG	7.645.255	1,61	458.939	Sandvik AB	8.896.195	1,88
148.459	Daimler Truck Holding AG	3.745.621	0,79		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>15.069.833</b>	<b>3,18</b>
250.704	Infineon Technologies AG	7.768.063	1,64				
172.834	Mercedes-Benz Group AG - Reg	11.028.537	2,32				
94.669	Puma AG Rudolf Dassler Sport	7.331.167	1,54				
27.748	Volkswagen AG Pfd	4.356.436	0,92				
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>51.464.346</b>	<b>10,84</b>				
<b>IRLAND</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
33.506	CRH plc	1.217.943	0,26	63.023	Compagnie Financiere Riche- mont SA - Reg	7.263.009	1,53
224.304	CRH plc	8.153.987	1,72	9.499	Lonza Group AG - Reg	6.236.083	1,31
104.512	Kingspan Group plc	9.305.748	1,96	141.581	Nestle SA - Reg	16.620.533	3,50
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>18.677.678</b>	<b>3,94</b>	3.094	Partners Group Holding AG - Reg	3.485.567	0,73
				54.878	Roche Holding AG	19.640.319	4,15
				212.300	SIG Combibloc Group AG	4.851.783	1,02
				57.164	Sika AG	17.161.766	3,61
				465.210	UBS Group AG	8.244.067	1,74
					<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>83.503.127</b>	<b>17,59</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
918.393	Enel SpA	5.572.809	1,17	659.214	3i Group plc	10.831.387	2,28
412.042	Nexi SpA	4.326.441	0,91	215.369	Ashtead Group plc	12.317.194	2,60
				149.789	Astrazeneca plc	17.959.195	3,78
				4.365.231	JD Sports Fashion plc	7.657.971	1,61
				34.723	Linde plc	10.087.032	2,13
				148.439	Persimmon plc	3.778.333	0,80
				1.216.560	Rentokil Initial plc	7.572.356	1,59
				140.125	Rio Tinto plc	10.083.293	2,12
				516.854	St James's Place plc	8.859.274	1,87

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
7.114.680	Vodafone Group plc	10.510.440	2,21
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>99.656.475</b>	<b>20,99</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>470.179.686</b>	<b>99,03</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>470.179.686</b>	<b>99,03</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
<b>Fonds</b>			
<b>IRLAND</b>			
192	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	18.907	0,00
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>18.907</b>	<b>0,00</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>18.907</b>	<b>0,00</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>18.907</b>	<b>0,00</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>470.198.593</b>	<b>99,03</b>
	<b>(Gesamtkosten: EUR 397.182.654)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>ITALIEN</b>			
20.034	KBC Group NV	1.309.823	2,15	196.891	Enel SpA	1.194.735	1,96
17.360	Melexis NV	1.458.240	2,39	64.811	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	658.804	1,08
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>2.768.063</b>	<b>4,54</b>	95.362	Nexi SpA	1.001.301	1,64
<b>DÄNEMARK</b>				<b>Italien, insgesamt</b>			
77.867	Tryg A/S	1.719.399	2,82			<b>2.854.840</b>	<b>4,68</b>
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>1.719.399</b>	<b>2,82</b>	<b>JERSEY - KANALINSELN</b>			
<b>FINNLAND</b>				158.000	WPP plc	1.875.296	3,08
50.679	Upm-Kymmene Oyj	1.503.139	2,47	<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>			
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>1.503.139</b>	<b>2,47</b>			<b>1.875.296</b>	<b>3,08</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
5.429	Air Liquide SA	862.777	1,42	5.588	ASM International NV	1.855.775	3,05
80.387	AXA SA	2.135.480	3,51	112.143	ING Groep NV	1.066.592	1,75
13.122	BNP Paribas	681.425	1,12	5.738	Koninklijke DSM NV	932.425	1,53
21.807	Compagnie de Saint-Gobain	1.183.466	1,94	<b>Niederlande, insgesamt</b>			
18.553	Edenred	833.401	1,37			<b>3.854.792</b>	<b>6,33</b>
2.447	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	1.589.082	2,61	<b>SPANIEN</b>			
23.457	Nexity SA	748.278	1,23	134.612	Iberdrola SA	1.335.351	2,19
6.785	Pernod-Ricard SA	1.352.251	2,22	68.628	Inditex SA	1.357.462	2,23
11.494	Schneider Electric SE	1.748.927	2,87	<b>Spanien, insgesamt</b>			
32.484	Total SA	1.495.239	2,45			<b>2.692.813</b>	<b>4,42</b>
12.515	Vinci SA	1.163.770	1,91	<b>SCHWEDEN</b>			
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>13.794.096</b>	<b>22,65</b>	14.276	Atlas Copco AB	591.321	0,97
<b>DEUTSCHLAND</b>				50.008	Sandvik AB	969.368	1,59
15.629	Brenntag AG	1.146.231	1,88	56.429	Volvo AB - B	961.051	1,58
25.814	Daimler Truck Holding AG	651.287	1,07	<b>Schweden, insgesamt</b>			
21.353	Mercedes-Benz Group AG - Reg	1.362.535	2,23			<b>2.521.740</b>	<b>4,14</b>
8.973	SAP SE	907.350	1,49	<b>SCHWEIZ</b>			
14.526	Siemens AG - Reg	1.825.337	3,00	10.307	Nestle SA - Reg	1.209.963	1,99
12.122	Siemens Healthineers AG	681.741	1,12	950	Partners Group Holding AG - Reg	1.070.229	1,76
3.998	Volkswagen AG Pfd	627.686	1,03	<b>Schweiz, insgesamt</b>			
23.242	Vonovia SE	983.369	1,61			<b>2.280.192</b>	<b>3,75</b>
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>8.185.536</b>	<b>13,43</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
<b>IRLAND</b>				133.982	3i Group plc	2.201.426	3,61
35.318	CRH plc	1.283.810	2,11	20.110	Anglo American plc	945.339	1,55
11.166	Medtronic Inc.	1.113.439	1,83	18.841	Astrazeneca plc	2.258.972	3,70
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>2.397.249</b>	<b>3,94</b>	54.272	Glaxosmithkline plc	1.057.874	1,74
				576.001	Ibstock plc	1.195.541	1,96
				14.229	London Stock Exchange Group plc	1.341.302	2,20
				43.121	Persimmon plc	1.097.592	1,80
				91.077	St James's Place plc	1.561.129	2,56

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
1.409.412	Vodafone Group plc	2.082.109	3,42
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>13.741.284</b>	<b>22,54</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>60.188.439</b>	<b>98,79</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>60.188.439</b>	<b>98,79</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>60.188.439</b>	<b>98,79</b>
	<b>(Gesamtkosten: EUR 56.683.327)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>IRLAND</b>			
185.649	Azelis Group NV	4.084.278	0,61	928.773	Dalata Hotel Group Limited	3.677.941	0,55
409.474	Fagron	6.764.510	1,01	1.114.891	Irish Continental Group plc	4.320.203	0,64
693	Lotus Bakeries NV	3.291.750	0,49				
152.203	Melexis NV	12.785.052	1,89		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>7.998.144</b>	<b>1,19</b>
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>26.925.590</b>	<b>4,00</b>				
<b>DÄNEMARK</b>				<b>INSEL MAN</b>			
178.480	Alk-Abello A/S	3.585.703	0,53	2.882.622	Strix Group plc	6.890.502	1,02
109.012	Simcorp A/S	7.283.641	1,08		<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>6.890.502</b>	<b>1,02</b>
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>10.869.344</b>	<b>1,61</b>				
<b>FINNLAND</b>				<b>ITALIEN</b>			
236.661	Huhtamaki Oyj	7.473.754	1,11	583.139	Carel Industries SpA	13.557.982	2,01
150.061	Musti Group Oyj	3.595.462	0,53	28.409	Diasorin SpA	4.031.237	0,60
100.721	Revenio Group Oyj	4.816.478	0,72	365.276	GVS SpA	3.009.874	0,45
195.503	Vaisala Oyj	8.435.954	1,25	410.948	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	4.177.286	0,62
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>24.321.648</b>	<b>3,61</b>	324.247	Marr SpA	4.866.947	0,72
				410.014	Technoprobe SpA	2.730.693	0,41
					<b>Italien, insgesamt</b>	<b>32.374.019</b>	<b>4,81</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>			
361.953	Elis SA	4.850.170	0,72	1.421.429	JTC plc	14.179.619	2,10
130.113	Korian-Medica	2.724.566	0,40		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>14.179.619</b>	<b>2,10</b>
358.365	Lectra	15.445.533	2,30				
32.966	Remy Cointreau	6.164.642	0,92				
415.560	Verallia SA	8.951.163	1,33				
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>38.136.074</b>	<b>5,67</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
286.057	Cancom AG	16.162.221	2,40	46.360	IMCD Group NV	7.197.390	1,07
138.526	Cherry AG	2.147.153	0,32	33.912	Shop Apotheke Europe NV	2.802.827	0,42
232.078	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	12.857.122	1,90		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>10.000.217</b>	<b>1,49</b>
229.852	CTS Eventim AG	14.255.421	2,12				
82.188	Gerresheimer AG	5.449.064	0,81				
17.873	Hypoport AG	6.155.461	0,91				
100.638	Nemetschek SE	8.836.016	1,31				
164.827	Norma Group SE	4.295.392	0,64				
175.624	Stabilus GmbH	7.906.592	1,17				
78.490	Stratec Biomedical AG	7.943.188	1,18				
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>86.007.630</b>	<b>12,76</b>				
<b>ISLAND</b>				<b>SPANIEN</b>			
1.872.455	Marel HF	9.924.012	1,48	227.683	Applus Services SA	1.704.207	0,25
	<b>Island, insgesamt</b>	<b>9.924.012</b>	<b>1,48</b>	583.556	Fluidra SA	15.347.523	2,28
					<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>17.051.730</b>	<b>2,53</b>
				<b>SCHWEDEN</b>			
				604.863	Avanza Bank Holding AB	14.116.456	2,10
				469.074	Cint Group AB	4.168.145	0,62
				885.554	Elekta AB - B	6.338.540	0,94
				1.161.698	Fortnox AB	5.820.122	0,86
				2.159.969	Karnov Group AB	12.456.670	1,86
				192.523	MIPS AB	16.338.740	2,42
				1.546.878	Munters Group AB	8.682.251	1,29
				416.620	Nordnet AB	6.830.340	1,01
				1.467.333	Stillfront Group AB	3.789.593	0,56

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>SCHWEDEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
270.506	Thule Group AB	9.782.761	1,45	1.195.848	Watches of Switzerland Group plc	16.132.163	2,40
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>88.323.618</b>	<b>13,11</b>		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>217.916.525</b>	<b>32,35</b>
<b>SCHWEIZ</b>				<b>Aktien, insgesamt</b>			
28.488	Belimo Holding AG	13.702.622	2,04			<b>673.157.766</b>	<b>99,94</b>
6.309	Inficon Holding AG	6.555.981	0,97	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
4.604	LEM Holding SA	10.072.073	1,50			<b>673.157.766</b>	<b>99,94</b>
834.500	SIG Combibloc Group AG	19.071.186	2,83	<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
15.525	Tecan Group AG - Reg	5.579.753	0,83	<b>Aktien</b>			
38.206	Vat Group AG	13.223.938	1,96	<b>DÄNEMARK</b>			
138.324	VZ Holding AG	11.820.643	1,75	49.761	Ow Bunker A/S**	0	0,00
16.685	Zur Rose Group AG	2.212.898	0,33		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>82.239.094</b>	<b>12,21</b>		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>			
288.437	Abcam plc	4.727.293	0,70			<b>0</b>	<b>0,00</b>
2.857.852	Ascential plc	11.721.416	1,74	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
601.018	Auction Technology Group plc	6.984.105	1,03	<b>Fonds</b>			
1.169.486	Biffa plc	4.428.501	0,66	<b>IRLAND</b>			
698.470	Big Yellow Group plc	12.695.528	1,89	34	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.317	0,00
725.341	CVS Group plc	15.381.263	2,28		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.317</b>	<b>0,00</b>
2.377.520	Dr. Martens plc	6.718.468	1,00		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>3.317</b>	<b>0,00</b>
290.675	FD Technologies plc	6.638.604	0,99	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
439.692	Future plc	13.538.409	2,01			<b>3.317</b>	<b>0,00</b>
43.191	Games Workshop Group plc	3.713.134	0,55	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
339.674	Genus plc	11.343.082	1,68			<b>673.161.083</b>	<b>99,94</b>
589.672	GlobalData plc	8.739.770	1,30	<b>(Gesamtkosten: EUR 548.825.583)</b>			
1.520.772	Howden Joinery Group plc	13.817.325	2,05	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
3.219.543	Ibstock plc	6.682.448	0,99	<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
7.361.532	Johnson Service Group plc	10.261.841	1,52				
148.528	Keywords Studios plc	4.604.913	0,68				
1.018.461	Moonpig Group plc	2.699.630	0,40				
103.267	Renishaw plc	4.729.163	0,70				
886.815	Rightmove plc	6.640.660	0,99				
699.097	RWS Holdings plc	3.060.913	0,45				
712.140	Shaftesbury plc	5.203.722	0,77				
553.047	St James's Place plc	9.479.650	1,41				
1.563.476	Synthomer plc	5.654.007	0,84				
828.561	Victoria plc	8.883.098	1,32				
313.497	Victrex plc	6.788.851	1,01				
1.339.320	Volution Group plc	6.648.568	0,99				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>			
354.347	Azelis Group NV	7.795.634	0,63	432.432	TeamViewer AG	5.822.697	0,47
1.439	Lotus Bakeries NV	6.835.250	0,55		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>183.876.925</b>	<b>14,88</b>
124.603	Melexis NV	10.466.652	0,85				
168.459	Umicore SA	6.630.546	0,54				
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>31.728.082</b>	<b>2,57</b>				
<b>DÄNEMARK</b>				<b>ISLAND</b>			
335.780	Alk-Abello A/S	6.745.894	0,55	3.647.596	Marel HF	19.332.258	1,56
233.984	Simcorp A/S	15.633.650	1,26		<b>Island, insgesamt</b>	<b>19.332.258</b>	<b>1,56</b>
594.754	Tryg A/S	13.132.899	1,06				
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>35.512.443</b>	<b>2,87</b>				
<b>FINNLAND</b>				<b>IRLAND</b>			
209.117	Cargotec Corp.	7.222.901	0,58	3.306.778	Dalata Hotel Group Limited	13.094.841	1,06
452.899	Huhtamaki Oyj	14.302.550	1,16	2.724.070	Irish Continental Group plc	10.555.771	0,86
289.749	Musti Group Oyj	6.942.386	0,56		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>23.650.612</b>	<b>1,92</b>
154.127	Revenio Group Oyj	7.370.353	0,60				
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>35.838.190</b>	<b>2,90</b>				
<b>FRANKREICH</b>				<b>ITALIEN</b>			
721.010	Bureau Veritas SA	18.702.999	1,52	135.941	Diasorin SpA	19.290.028	1,56
229.379	Edenred	10.303.705	0,83	1.698.924	Finacobank Banca Fineco SpA	23.487.624	1,90
1.332.202	Elis SA	17.851.507	1,45	790.691	GVS SpA	6.515.294	0,53
421.891	Korian-Medica	8.834.398	0,71	1.663.126	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	16.905.675	1,37
68.105	Remy Cointreau	12.735.635	1,03	588.730	Marr SpA	8.836.837	0,72
50.024	SEB SA	6.333.038	0,51	541.840	Nexi SpA	5.689.320	0,46
153.046	Ubisoft Entertainment SA	6.114.188	0,49	862.387	Technoprobe SpA	5.743.497	0,46
827.335	Verallia SA	17.820.796	1,44		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>86.468.275</b>	<b>7,00</b>
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>98.696.266</b>	<b>7,98</b>				
<b>DEUTSCHLAND</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>			
540.639	Cancom AG	30.546.104	2,47	871.136	JTC plc	8.690.111	0,70
66.126	Carl Zeiss Meditec AG	9.717.216	0,79		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>8.690.111</b>	<b>0,70</b>
511.401	CompuGroup Medical SE & Company KgaA	28.331.615	2,29				
524.951	CTS Eventim AG	32.557.461	2,64				
60.864	Dermapharm Holding SE	3.511.853	0,28				
155.259	Gerresheimer AG	10.293.672	0,83				
27.154	Hypoport AG	9.351.838	0,76				
119.216	Nemetschek SE	10.467.165	0,85				
369.196	Norma Group SE	9.621.248	0,78				
95.309	Puma AG Rudolf Dassler Sport	7.380.729	0,60				
255.546	Stabilus GmbH	11.504.681	0,93				
145.955	Stratec Biomedical AG	14.770.646	1,19				
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>354.877.645</b>	<b>28,48</b>				
				<b>LUXEMBURG</b>			
				304.000	Eurofins Scientific SE	27.332.640	2,22
					<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>27.332.640</b>	<b>2,22</b>
				<b>NIEDERLANDE</b>			
				78.278	ASM International NV	25.996.124	2,10
				675.452	Davide Campari-Milano NV	7.129.396	0,58
				67.460	IMCD Group NV	10.473.165	0,85
				55.176	Shop Apotheke Europe NV	4.560.296	0,37
					<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>48.158.981</b>	<b>3,90</b>
				<b>SPANIEN</b>			
				864.717	Applus Services SA	6.472.407	0,52
				1.079.229	Fluidra SA	28.383.723	2,30
					<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>34.856.130</b>	<b>2,82</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>SCHWEDEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
1.171.181	Avanza Bank Holding AB	27.333.337	2,21	2.058.905	Watches of Switzerland Group plc	27.774.928	2,24
1.658.962	Elekta AB - B	11.874.373	0,96				
2.486.044	Fortnox AB	12.455.113	1,01		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>402.976.944</b>	<b>32,56</b>
613.690	Nordnet AB	10.061.234	0,81				
1.476.535	Stillfront Group AB	3.813.358	0,31		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>1.233.550.937</b>	<b>99,77</b>
447.776	Thule Group AB	16.193.673	1,31				
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>81.731.088</b>	<b>6,61</b>		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.233.550.937</b>	<b>99,77</b>
<b>SCHWEIZ</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
57.582	Belimo Holding AG	27.696.730	2,24	<b>Fonds</b>			
10.253	Inficon Holding AG	10.654.378	0,86	<b>IRLAND</b>			
1.512.816	SIG Combibloc Group AG	34.573.033	2,80	33.232	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	3.264.252	0,26
29.329	Tecan Group AG - Reg	10.540.970	0,85		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.264.252</b>	<b>0,26</b>
79.329	Vat Group AG	27.457.513	2,22		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>3.264.252</b>	<b>0,26</b>
28.496	Zur Rose Group AG	3.779.368	0,31		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>3.264.252</b>	<b>0,26</b>
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>114.701.992</b>	<b>9,28</b>		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.236.815.189</b>	<b>100,03</b>
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>					<b>(Gesamtkosten: EUR 1.124.433.334)</b>		
546.894	Abcam plc	8.963.233	0,72	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
1.403.320	Allfunds Group plc	14.650.661	1,18				
5.347.541	Ascential plc	21.932.819	1,77				
1.147.295	Auction Technology Group plc	13.332.094	1,08				
536.116	Aveva Group plc	15.543.064	1,26				
2.055.814	Biffa plc	7.784.766	0,63				
1.494.773	Big Yellow Group plc	27.169.286	2,19				
1.418.154	CVS Group plc	30.072.752	2,43				
4.300.548	Dr. Martens plc	12.152.619	0,98				
4.382.881	Elementis plc	6.171.893	0,50				
536.463	FD Technologies plc	12.252.053	0,99				
851.432	Future plc	26.216.157	2,12				
69.122	Games Workshop Group plc	5.942.425	0,48				
650.890	Genus plc	21.735.838	1,76				
788.051	GlobalData plc	11.680.027	0,94				
2.881.714	Howden Joinery Group plc	26.182.479	2,12				
6.120.606	Ibstock plc	12.703.862	1,03				
1.965.615	Moonpig Group plc	5.210.246	0,42				
311.086	Renishaw plc	14.246.337	1,15				
971.312	Rentokil Initial plc	6.045.835	0,49				
1.477.144	RWS Holdings plc	6.467.498	0,52				
1.415.422	Shaftesbury plc	10.342.718	0,84				
1.535.458	St James's Place plc	26.318.929	2,13				
2.925.749	Synthomer plc	10.580.402	0,86				
1.012.124	Victoria plc	10.851.098	0,88				
491.933	Victrex plc	10.652.925	0,85				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - European Select

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>SPANIEN</b>			
137.035	Azelis Group NV	3.014.770	0,19	511.775	Amadeus IT Holding SA - A	30.286.845	1,87
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>3.014.770</b>	<b>0,19</b>	2.221.525	Inditex SA	43.941.765	2,71
<b>DÄNEMARK</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
196.976	DSV A/S	34.438.286	2,12	720.628	Atlas Copco AB - A	34.171.546	2,10
635.702	Novo Nordisk A/S	64.002.254	3,94	842.913	Epiroc AB	16.436.797	1,01
3.049.998	Tryg A/S	67.347.704	4,15	1.334.256	Sandvik AB	25.863.573	1,60
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>165.788.244</b>	<b>10,21</b>		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>76.471.916</b>	<b>4,71</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
113.492	Air Liquide SA	18.036.149	1,11	87.212	Lonza Group AG - Reg	57.254.584	3,53
856.465	Dassault Systemes SE	38.296.832	2,36	835.116	Nestle SA - Reg	98.036.270	6,04
20.186	Hermes International	26.070.219	1,61	8.109	Partners Group Holding AG - Reg	9.135.249	0,56
214.676	Legrand SA	18.543.713	1,14	99.186	Roche Holding AG	35.497.732	2,19
179.773	L'Oreal SA	65.410.406	4,03	37.729	Schindler Holding AG	7.332.699	0,45
138.921	Louis Vuitton Moet Hennessy SE	90.215.297	5,55	205.463	Sika AG	61.684.066	3,80
302.005	Pernod-Ricard SA	60.189.597	3,71	97.587	Vat Group AG	33.777.009	2,08
469.955	Schneider Electric SE	71.508.353	4,41		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>302.717.609</b>	<b>18,65</b>
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>388.270.566</b>	<b>23,92</b>	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				1.769.725	Allfunds Group plc	18.475.929	1,14
847.655	Brenntag AG	62.167.018	3,83	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
669.236	SAP SE	67.673.144	4,17			<b>18.475.929</b>	<b>1,14</b>
39.143	Sartorius AG	15.723.743	0,97	<b>Aktien, insgesamt</b>			
688.008	Siemens Healthineers AG	38.693.570	2,38			<b>1.591.351.001</b>	<b>98,03</b>
727.010	Zalando SE	33.442.460	2,06	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>217.699.935</b>	<b>13,41</b>			<b>1.591.351.001</b>	<b>98,03</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
2.353.841	Fincobank Banca Fineco SpA	32.541.852	2,00	<b>Fonds</b>			
1.487.170	Nexi SpA	15.615.285	0,96	<b>IRLAND</b>			
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>48.157.137</b>	<b>2,96</b>	281.536	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	27.654.165	1,70
<b>NIEDERLANDE</b>							
16.825	Adyen NV	30.436.425	1,87				
160.083	ASML Holding NV	97.650.630	6,02				
5.367.143	Davide Campari-Milano NV	56.650.194	3,49				
265.399	IMCD Group NV	41.203.195	2,54				
251.238	Koninklijke DSM NV	40.826.175	2,51				
751.317	STMicroelectronics NV	29.759.666	1,83				
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>296.526.285</b>	<b>18,26</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - European Select

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b> (Fortsetzung)			
<b>Fonds (Fortsetzung)</b>			
<b>IRLAND (Fortsetzung)</b>			
1.020.408	Insight Liquidity Funds plc	985.714	0,06
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>28.639.879</b>	<b>1,76</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>28.639.879</b>	<b>1,76</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>28.639.879</b>	<b>1,76</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.619.990.880</b>	<b>99,79</b>
	<b>(Gesamtkosten: EUR 1.264.696.063)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.



## Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>				<b>Aktien</b>			
<b>SPANIEN</b>				<b>DÄNEMARK</b>			
1.537.498	Applus Services SA	11.508.173	0,65	280.528	Ow Bunker A/S**	0	0,00
1.584.055	Fluidra SA	41.660.647	2,35		<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
	<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>53.168.820</b>	<b>3,00</b>		<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>SCHWEDEN</b>				<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>			
1.525.354	Avanza Bank Holding AB	35.599.123	2,01			<b>0</b>	<b>0,00</b>
1.167.144	Cint Group AB	10.371.127	0,59	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
2.251.701	Elektro AB - B	16.117.028	0,91	<b>Fonds</b>			
3.120.200	Fortnox AB	15.632.242	0,88	<b>IRLAND</b>			
749.099	Hemnet Group AB	10.265.653	0,58	207.172	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	20.349.761	1,15
136.990	MIPS AB	11.625.853	0,66		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>20.349.761</b>	<b>1,15</b>
1.313.431	Nordnet AB	21.533.245	1,21		<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>20.349.761</b>	<b>1,15</b>
1.502.529	Stillfront Group AB	3.880.491	0,22	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
657.228	Thule Group AB	23.768.437	1,34		<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>1.769.745.752</b>	<b>99,84</b>
150.041	Vitrolife AB	4.508.797	0,25		<b>(Gesamtkosten: EUR 1.312.756.612)</b>		
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>153.301.996</b>	<b>8,65</b>				
<b>SCHWEIZ</b>				<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
102.547	Belimo Holding AG	49.324.729	2,78	<i>**Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.</i>			
61.346	Burckhardt Compression Holding AG	29.297.504	1,65				
19.275	Inficon Holding AG	20.029.565	1,13				
15.321	LEM Holding SA	33.517.424	1,90				
2.167.726	SIG Combibloc Group AG	49.539.972	2,79				
132.156	Sika AG	39.675.852	2,24				
172.084	Skan Group AG	10.756.128	0,61				
64.694	Tecan Group AG - Reg	23.251.305	1,31				
137.248	Vat Group AG	47.504.554	2,68				
35.412	Zur Rose Group AG	4.696.623	0,26				
	<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>307.593.656</b>	<b>17,35</b>				
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>							
1.791.255	Allfunds Group plc	18.700.702	1,05				
	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>18.700.702</b>	<b>1,05</b>				
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>1.749.395.991</b>	<b>98,69</b>				
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>1.749.395.991</b>	<b>98,69</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

## Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>					
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>INDIEN</b>					
20.365	Aristocrat Leisure Limited	561.257	1,08	224.465	Embassy Office Parks REIT	1.101.222	2,11		
75.754	Australia & New Zealand Banking Group Limited	1.570.094	3,01	43.036	HDFC Bank Limited	835.080	1,60		
410.033	Deterra Royalties Limited	1.487.226	2,85	120.293	Hindalco Industries Limited	904.085	1,73		
150.606	Dexus Property Group	1.238.418	2,38	188.977	Petronet Lng Limited	483.199	0,93		
12.337	Macquarie Group Limited	1.883.189	3,61	61.076	Tech Mahindra Limited	1.208.587	2,31		
45.478	Oz Minerals Limited	910.826	1,75	<b>Indien, insgesamt</b>			<b>4.532.173</b>	<b>8,68</b>	
152.352	Transurban Group	1.550.238	2,97	<b>INDONESIEN</b>					
<b>Australien, insgesamt</b>				3.431.878	Bank Rakyat Indonesia	1.113.561	2,13		
				3.682.200	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1.174.273	2,25		
				<b>Indonesien, insgesamt</b>				<b>2.287.834</b>	<b>4,38</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>SÜDKOREA</b>					
182.000	China Mengniu Dairy Company Limited	980.718	1,88	33.630	Hanon Systems	327.408	0,63		
270.000	China Resources Land Limited	1.258.394	2,41	23.397	KB Financial Group Inc.	1.183.317	2,27		
595	JD.com Inc. - A	17.778	0,03	9.230	Kia Corp.	563.526	1,08		
65.485	NetEase Inc.	1.202.433	2,31	41.204	Kt Corp.	1.213.635	2,33		
18.400	Tencent Holdings Limited	879.189	1,69	3.217	Posco Holdings Inc.	777.676	1,49		
<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>				42.894	Samsung Electronics Company Limited Pfd	2.229.551	4,27		
				13.573	SK Telecom Company Limited	637.189	1,22		
				<b>Südkorea, insgesamt</b>				<b>6.932.302</b>	<b>13,29</b>
<b>CHINA</b>				<b>SINGAPUR</b>					
582.000	Baoshan Iron & Steel Company Limited - A	618.845	1,19	704.000	Capitamall Trust	1.170.429	2,24		
1.189.000	China Construction Bank Corp.	894.247	1,71	813.200	Digital Core REIT Management Pte Limited	902.652	1,73		
192.500	China Merchants Bank Company Limited - H	1.512.931	2,90	287.900	Keppel Corp. Limited	1.365.735	2,62		
140.042	Inner Mongolia Yili Industrial Group Company Limited - A	813.808	1,56	68.300	United Overseas Bank Limited	1.615.964	3,10		
117.500	Ping An Insurance Group Company of China Limited	834.955	1,60	<b>Singapur, insgesamt</b>				<b>5.054.780</b>	<b>9,69</b>
14.900	Wuliangye Yibin Company Limited - A	363.949	0,70						
<b>China, insgesamt</b>				<b>TAIWAN</b>					
				88.000	Chailease Holding Company Limited	778.594	1,49		
				137.000	Chroma ATE Inc.	860.683	1,65		
				11.000	MediaTek Inc.	347.449	0,67		
				218.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	4.542.356	8,71		
				53.000	Yageo Corp.	802.816	1,54		
				<b>Taiwan, insgesamt</b>				<b>7.331.898</b>	<b>14,06</b>
<b>HONGKONG</b>									
151.800	AIA Group Limited	1.598.170	3,06						
128.000	Galaxy Entertainment Group Limited	768.189	1,47						
20.322	Hong Kong Exchanges and Clearing Limited	963.759	1,85						
85.500	Sun Hung Kai Properties Limited	1.021.886	1,96						
376.000	Xinyi Glass Holdings Limited	912.224	1,75						
<b>Hongkong, insgesamt</b>									

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>THAILAND</b>			
315.200	PTT Exploration & Production pcl	1.365.068	2,62
2.208.300	Thai Beverage pcl	1.166.686	2,23
	<b>Thailand, insgesamt</b>	<b>2.531.754</b>	<b>4,85</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>52.513.464</b>	<b>100,67</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>52.513.464</b>	<b>100,67</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>52.513.464</b>	<b>100,67</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 44.244.501)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
86.300	Shaw Communications Inc.	2.680.788	0,41	41.053	Broadcom Inc.	25.850.253	3,97
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>2.680.788</b>	<b>0,41</b>	84.629	Cerence Inc.	3.055.107	0,47
<b>KAIMANINSELN</b>				65.800	Cisco Systems Inc.	3.669.008	0,56
72.106	Globalfoundries Inc.	4.500.857	0,69	62.600	Comcast Corp.	2.930.932	0,45
105.151	Pagseguro Digital Limited	2.108.278	0,32	105.992	Dell Technologies Inc. - C	5.319.738	0,82
203.876	Smart Global Holdings Inc.	5.266.117	0,81	543.048	Dropbox Inc. - A	12.625.866	1,94
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>11.875.252</b>	<b>1,82</b>	83.109	Dxc Technology Company	2.711.847	0,42
<b>DEUTSCHLAND</b>				245.706	Ebay Inc.	14.069.125	2,16
77.200	TeamViewer AG	1.156.597	0,18	363.353	Eiger Biopharmaceuticals Inc.	3.015.830	0,46
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>1.156.597</b>	<b>0,18</b>	46.804	F5 Inc.	9.779.696	1,50
<b>ISRAEL</b>				46.708	Fidelity National Information Services Inc.	4.690.417	0,72
12.700	Cyberark Software Limited	2.143.125	0,33	61.123	Fiserv Inc.	6.197.872	0,95
6.536	Kornit Digital Limited	540.462	0,08	35.723	Fortinet Inc.	12.207.978	1,87
	<b>Israel, insgesamt</b>	<b>2.683.587</b>	<b>0,41</b>	155.852	GoDaddy Inc. - A	13.044.812	2,00
<b>JAPAN</b>				94.942	Hireright Holdings Corp.	1.623.508	0,25
906.500	Renesas Electronics Corp.	10.695.021	1,64	380.692	HP inc.	13.819.120	2,12
70.900	Sumco Corp.	1.184.052	0,18	24.964	Intapp Inc.	599.386	0,09
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>11.879.073</b>	<b>1,82</b>	108.450	Intel Corp.	5.374.782	0,82
<b>NIEDERLANDE</b>				68.946	Lam Research Corp.	37.066.060	5,70
42.309	NXP Semiconductor NV	7.830.550	1,20	99.844	Lumentum Holdings Lite US	9.744.774	1,50
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>7.830.550</b>	<b>1,20</b>	236.615	Marvell Technology Inc.	16.967.662	2,60
<b>SCHWEDEN</b>				95.000	Microchip Technology Inc.	7.138.300	1,10
497.300	Telefonaktiebolaget LM Ericsson - ADR	4.545.322	0,70	170.162	Micron Technology Inc.	13.253.918	2,03
	<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>4.545.322</b>	<b>0,70</b>	74.816	Microsoft Corp.	23.066.521	3,54
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				138.760	NetApp Inc.	11.517.080	1,77
96.758	Activision Blizzard Inc.	7.751.283	1,19	425.586	Nortonlifelock Inc.	11.286.541	1,73
106.966	Advanced Energy Industries Inc.	9.207.633	1,41	68.900	Oracle Corp.	5.700.097	0,87
10.301	Alphabet Inc. - A	28.650.686	4,40	19.897	Palo Alto Networks Inc.	12.386.081	1,90
4.813	Alphabet Inc. - C	13.442.661	2,06	38.671	PowerSchool Holdings Inc.	638.458	0,10
95.768	Analog Devices Inc.	15.818.958	2,43	85.750	Qorvo Inc.	10.641.575	1,63
214.660	Apple Inc.	37.481.782	5,75	133.307	Rambus Inc.	4.251.160	0,65
169.129	Applied Materials Inc.	22.291.202	3,42	43.890	Sailpoint Technologies Holding Inc.	2.246.290	0,34
32.972	Arista Networks Inc.	4.582.449	0,70	23.977	Salesforce.com Inc.	5.090.797	0,78
609.625	Bloom Energy Corp.	14.722.444	2,26	234.733	Samsara Inc.	3.760.423	0,58
				8.800	Splunk Inc.	1.307.768	0,20
				122.566	Synaptics Inc.	24.451.917	3,75
				66.781	Synopsys Inc.	22.256.104	3,42
				33.888	Tenable Holdings Inc.	1.958.388	0,30
				203.018	Teradyne Inc.	24.002.818	3,68
				125.774	Thoughtworks Holding Inc.	2.617.357	0,40
				1.900	T-Mobile USA Inc.	243.865	0,04
				15.300	Twitter Inc.	591.957	0,09
				24.188	Verint Systems Inc.	1.250.520	0,19
				148.600	Viavi Solutions Inc.	2.389.488	0,37
				70.514	Visa Inc. - A	15.637.889	2,40
				39.329	VMware Inc. - A	4.478.393	0,69

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Technology

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
291.347	Western Digital Corp.	14.465.379	2,22
413.561	Xperi Holding Corp.	7.162.877	1,10
25.300	Zendesk Inc.	3.043.337	0,47
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>595.148.169</b>	<b>91,33</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>637.799.338</b>	<b>97,87</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>637.799.338</b>	<b>97,87</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>637.799.338</b>	<b>97,87</b>
	<b>(Gesamtkosten: USD 463.333.314)</b>		

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.





## Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert GBP	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>GUERNSEY - KANALINSELN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>			
2.895.980	Sherborne Investors Guernsey	1.349.527	0,58	204.941	United Utilities Group plc	2.304.561	0,99
	<b>Guernsey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>1.349.527</b>	<b>0,58</b>	1.016.474	Wincanton plc	3.923.590	1,69
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
						<b>225.184.338</b>	<b>96,80</b>
654.679	3i Group plc	9.090.218	3,91	<b>Aktien, insgesamt</b>			
232.713	Astrazeneca plc	23.578.480	10,14	<b>226.533.865</b>			
1.027.578	BAE Systems plc	7.371.845	3,17	<b>Fonds</b>			
3.756.140	BT Group plc	6.843.687	2,94	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
4.601.202	Centrica plc	3.684.643	1,58	39.794	Unbound Group plc	14.127	0,00
820.300	Chesnara plc	2.489.611	1,07	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
308.877	Compass Group	5.096.471	2,19	<b>14.127</b>			
2.147.684	Direct Line Insurance Group plc	5.908.279	2,54	<b>0,00</b>			
1.135.398	DS Smith plc	3.657.117	1,57	<b>Fonds, insgesamt</b>			
1.624.605	Electrocomponents plc	17.610.718	7,57	<b>14.127</b>			
892.941	Elementis plc	1.062.600	0,46	<b>0,00</b>			
68.171	Ferguson plc	7.076.150	3,04	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
864.370	Glaxosmithkline plc	14.237.903	6,12	<b>226.547.992</b>			
87.682	Go-Ahead Group plc	722.500	0,31	<b>97,38</b>			
3.623.263	Hays plc	4.449.367	1,91	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
119.309	Hostmore plc	79.340	0,03	<b>Fonds</b>			
213.852	Imi plc	2.914.803	1,25	<b>IRLAND</b>			
670.518	Imperial Brands plc	10.798.692	4,64	2.810.958	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	2.810.958	1,21
4.323.223	ITV plc	3.541.584	1,52	<b>Irland, insgesamt</b>			
304.467	JD Wetherspoon plc	2.379.410	1,02	<b>2.810.958</b>			
174.691	Johnson Matthey plc	3.281.570	1,41	<b>1,21</b>			
2.285.276	Legal & General Group plc	6.215.951	2,67	<b>Fonds, insgesamt</b>			
2.862.131	Marks & Spencer Group plc	4.427.716	1,91	<b>2.810.958</b>			
1.771.758	Melrose Industries plc	2.212.040	0,95	<b>1,21</b>			
506.146	Morgan Crucible Company	1.569.053	0,67	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
138.082	Morgan Sindall plc	3.334.680	1,43	<b>2.810.958</b>			
199.796	Oxford Instruments plc	4.215.696	1,81	<b>1,21</b>			
970.889	Pearson plc	7.287.493	3,14	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
157.333	Pennon Group plc	1.691.330	0,73	<b>229.358.950</b>			
1.335.337	Phoenix Group Holdings plc	8.198.968	3,53	<b>98,59</b>			
1.256.330	Rank Group plc	1.691.020	0,73	<b>(Gesamtkosten: GBP 217.491.065)</b>			
310.347	RELX plc	7.395.569	3,18	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
2.232.995	Rentokil Initial plc	11.745.554	5,05				
354.824	Smiths Group plc	5.153.818	2,22				
824.213	Tate & Lyle plc	6.034.888	2,59				
2.085.884	Tesco plc	5.757.040	2,47				
178.014	Unilever plc	6.150.383	2,65				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
219	Shopify Inc. - A	148.035	0,60	2.084	Union Pacific Corp.	569.370	2,30
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>148.035</b>	<b>0,60</b>	4.652	United Parcel Service Inc.	997.668	4,03
				3.205	Vertex Pharmaceuticals Inc.	836.409	3,38
				2.844	Voya Financial Inc.	188.699	0,76
					<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>22.046.953</b>	<b>89,11</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Aktien, insgesamt</b>			
4.824	Globalfoundries Inc.	301.114	1,22			<b>22.496.102</b>	<b>90,93</b>
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>301.114</b>	<b>1,22</b>	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
						<b>22.496.102</b>	<b>90,93</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
1.611	Adobe Systems Inc.	734.004	2,97	<b>Fonds</b>			
2.379	Agco Corp.	347.405	1,41	<b>IRLAND</b>			
460	Alphabet Inc. - A	1.279.421	5,17	775.566	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	775.566	3,13
6.160	American Electric Power Company Inc.	614.583	2,48		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>775.566</b>	<b>3,13</b>
1.470	Block Inc.	199.332	0,81	<b>Fonds, insgesamt</b>			
1.992	Cirrus Logic Inc.	168.902	0,68			<b>775.566</b>	<b>3,13</b>
22.779	Cisco Systems Inc.	1.270.157	5,13	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
13.223	Coca Cola Company	819.826	3,31			<b>775.566</b>	<b>3,13</b>
2.695	CrowdStrike Holdings Inc. - A	611.981	2,47	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
11.243	CVS Health Corp.	1.137.904	4,60			<b>23.271.668</b>	<b>94,06</b>
5.035	Darling International Inc.	404.713	1,64	<b>(Gesamtkosten: USD 21.877.783)</b>			
2.920	Doordash Inc. - A	342.195	1,38	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
2.541	Doximity Inc.	132.361	0,53				
10.172	Electronic Arts Inc.	1.286.860	5,21				
2.747	Exact Sciences Corp.	192.070	0,78				
3.767	Gap Inc.	53.039	0,21				
7.900	General Motors Company	345.546	1,40				
1.080	Herc Holdings Inc.	180.457	0,73				
4.340	Hilton Worldwide Holdings Inc.	658.552	2,66				
8.686	Konitoor Brands Inc.	359.166	1,45				
1.554	Lam Research Corp.	835.446	3,38				
11.980	Livent Corp.	312.319	1,26				
690	Mastercard Inc. - A	246.592	1,00				
3.958	Microsoft Corp.	1.220.291	4,94				
2.150	Mirati Therapeutics Inc.	176.773	0,71				
2.619	Ncino Inc.	107.327	0,43				
5.280	Northern Trust Corp.	614.856	2,49				
28.394	Nov Inc.	556.806	2,25				
7.897	Ranpak Holdings Corp.	161.336	0,65				
3.859	Salesforce.com Inc.	819.343	3,31				
4.112	Schnitzer Steel Industries Inc.	213.577	0,86				
2.967	Starbucks Corp.	269.908	1,09				
7.392	State Street Corp.	643.991	2,61				
727	Svb Financial Group	406.720	1,64				
4.273	Target Corp.	906.816	3,68				
5.974	Teradata Corp.	294.458	1,19				
531	Teradyne Inc.	62.780	0,25				
4.519	Transunion	466.994	1,88				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>IRLAND</b>					
EUR	6.969.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	6.713.559	0,68	EUR	4.767.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	4.662.264	0,48
EUR	1.508.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	1.491.061	0,15	EUR	1.275.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	1.259.921	0,13
EUR	5.600.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	5.739.064	0,59	EUR	1.181.000	AIB Group plc Perp FRN	1.225.161	0,12
EUR	2.300.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	2.152.891	0,22	EUR	3.710.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	3.445.430	0,35
EUR	4.400.000	Deutsche Lufthansa AG 2.88% 16/05/2027	4.100.581	0,42	EUR	1.793.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	1.646.660	0,17
EUR	1.800.000	Deutsche Lufthansa AG 3.75% 11/02/2028	1.736.670	0,18	EUR	4.533.000	Eircom Finance DAC 3.50% 15/05/2026	4.476.904	0,46
EUR	1.381.000	Gruenenthal GmbH 3.63% 15/11/2026	1.372.268	0,14	EUR	2.347.000	Experian Europe DAC 1.56% 16/05/2031	2.307.187	0,24
EUR	1.215.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.184.646	0,12			<b>Irland, insgesamt</b>	<b>19.023.527</b>	<b>1,95</b>
EUR	1.327.000	Gruenenthal GmbH 4.13% 15/05/2028	1.293.848	0,13			<b>INSEL MAN</b>		
EUR	7.787.000	HT Troplast AG 9.25% 15/07/2025	7.800.141	0,80	EUR	3.200.000	Playtech plc 3.75% 12/10/2023	3.217.600	0,33
EUR	1.308.000	Ineos Styrolution Group GmbH 2.25% 16/01/2027	1.191.757	0,12			<b>Insel Man, insgesamt</b>	<b>3.217.600</b>	<b>0,33</b>
EUR	1.800.000	Mahle GmbH 2.38% 14/05/2028	1.536.789	0,16			<b>ITALIEN</b>		
EUR	3.000.000	Novelis Sheet Ingot GmbH 3.38% 15/04/2029	2.861.667	0,29	EUR	932.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	854.648	0,09
EUR	3.555.000	PCF GmbH 4.75% 15/04/2026	3.427.953	0,35	EUR	815.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	793.445	0,08
EUR	2.610.000	Peach Property Finance GmbH 3.50% 15/02/2023	2.595.921	0,26	EUR	3.000.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	2.820.618	0,29
EUR	3.240.000	Peach Property Finance GmbH 4.38% 15/11/2025	3.212.832	0,33	EUR	1.444.000	Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 1.88% 09/01/2026	1.314.666	0,13
EUR	3.100.000	Schaeffler AG 2.75% 12/10/2025	3.118.459	0,32	EUR	3.870.000	Banco BPM SpA 1.75% 24/04/2023	3.918.030	0,40
EUR	3.000.000	Schaeffler AG 3.38% 12/10/2028	2.943.960	0,30	EUR	3.261.000	Fis Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5.63% 01/08/2027	3.106.280	0,32
EUR	4.112.000	Schenck Process Holding GmbH 5.38% 15/06/2023	4.079.521	0,42	EUR	1.673.000	Lkq Italia Bondco 3.88% 01/04/2024	1.731.351	0,18
EUR	4.140.000	SGL Carbon SE 4.63% 30/09/2024	4.096.875	0,42	EUR	3.342.000	Nexi SpA 1.75% 31/10/2024	3.358.839	0,34
EUR	2.288.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 2.00% 15/07/2025	2.204.978	0,22	EUR	2.000.000	Telecom Italia SpA 4.00% 11/04/2024	2.054.208	0,21
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>82.975.657</b>	<b>8,47</b>			<b>Italien, insgesamt</b>	<b>19.952.085</b>	<b>2,04</b>
<b>INDIEN</b>				<b>JERSEY - KANALINSELN</b>					
USD	3.630.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	3.146.318	0,32	EUR	5.384.000	Adient Global Holdings Limited 3.50% 15/08/2024	5.298.445	0,54
USD	8.251.000	GMR Hyderabad International Airport 4.25% 27/10/2027	6.800.672	0,69	EUR	8.100.000	Avis Budget Finance plc 4.13% 15/11/2024	8.157.173	0,84
		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>9.946.990</b>	<b>1,01</b>	USD	5.340.682	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	4.435.740	0,45
					GBP	1.855.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	2.235.447	0,23

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>JERSEY - KANALINSELN (Fortsetzung)</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.542.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	1.401.457	0,14	EUR	4.300.000	Constellium SE 4.25% 15/02/2026	4.311.408	0,44
		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>21.528.262</b>	<b>2,20</b>	EUR	3.200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	3.200.000	0,33
<b>LUXEMBURG</b>				<b>NIEDERLANDE (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.600.000	Adler Group SA 3.25% 05/08/2025	1.414.190	0,14	EUR	4.400.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	4.440.709	0,45
EUR	2.295.000	Altice Financing SA 3.00% 15/01/2028	2.028.983	0,21	EUR	6.028.000	Darling Global Finance BV 3.63% 15/05/2026	6.080.754	0,62
EUR	1.236.000	Altice Financing SA 4.25% 15/08/2029	1.106.653	0,11	GBP	2.900.000	Diebold Nixdorf Dutch Holding BV 9.00% 15/07/2025	2.632.961	0,27
EUR	4.959.000	Altice France Holding SA 8.00% 15/05/2027	5.128.287	0,52	EUR	2.100.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	4.275.298	0,44
EUR	3.300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	3.014.090	0,31	EUR	2.100.000	Iberdrola International BV Perp FRN	1.912.576	0,19
EUR	3.900.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	3.641.955	0,38	USD	4.600.000	ING Groep NV Perp FRN	3.609.834	0,37
GBP	1.855.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	2.110.726	0,22	EUR	1.971.000	Lkq European Holdings BV 4.13% 01/04/2028	2.044.691	0,21
EUR	1.138.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 12/02/2036	1.004.539	0,10	EUR	2.010.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	1.766.337	0,18
EUR	1.150.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.34% 13/08/2041	947.695	0,10	EUR	3.020.000	Stedin Holding NV Perp FRN	2.912.284	0,30
EUR	4.249.000	Canpack SA 2.38% 01/11/2027	3.921.538	0,40	EUR	3.140.000	Stichting Ak Rabobank Perp 6.50%	3.670.764	0,37
EUR	1.704.000	Cirsa Finance International Sarl 4.50% 15/03/2027	1.617.040	0,16	EUR	4.646.324	Summer Bidco BV 9.00% 15/11/2025	4.638.645	0,47
EUR	2.673.189	Cirsa Finance International Sarl 6.25% 20/12/2023	2.690.352	0,27	EUR	3.300.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	3.056.081	0,31
EUR	1.613.000	Gamma Bondco Sarl 8.13% 15/11/2026	1.583.008	0,16	EUR	5.700.000	Telefonica Europe BV Perp FRN	5.913.992	0,60
EUR	1.331.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 6.75% 01/11/2025	1.328.398	0,14	EUR	3.758.000	Tennet Holding BV Perp FRN	3.773.133	0,38
GBP	2.120.000	Garfunkelux Holdingco 3 SA 7.75% 01/11/2025	2.497.379	0,25	EUR	5.221.000	Tennet Holding BV Perp FRN	5.342.829	0,54
EUR	2.100.000	Grand City Properties SA Perp FRN	1.870.561	0,19	EUR	1.733.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	1.561.629	0,16
EUR	7.243.000	InPost SA 2.25% 15/07/2027	6.667.305	0,68	EUR	4.200.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	3.967.716	0,40
EUR	2.000.000	Matterhorn Telecom SA 2.63% 15/09/2024	2.008.133	0,20	EUR	4.873.000	United Group BV 4.88% 01/07/2024	4.874.598	0,50
EUR	3.835.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	3.515.074	0,36	EUR	1.000.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	1.199.049	0,12
EUR	2.394.000	Sani/Ikos Financial Holdings 1 Sarl 5.63% 15/12/2026	2.353.198	0,24			<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>77.820.108</b>	<b>7,92</b>
		<b>Luxemburg, insgesamt</b>	<b>50.449.104</b>	<b>5,14</b>			<b>NORWEGEN</b>		
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>NORWEGEN</b>					
EUR	2.848.000	Ashland Services BV 2.00% 30/01/2028	2.634.820	0,27	EUR	3.475.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	3.169.104	0,32
							<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>3.169.104</b>	<b>0,32</b>
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>SPANIEN</b>					
EUR	4.349.000	Grifols Escrow Issuer SA 3.88% 15/10/2028	4.146.139	0,43	EUR	3.531.000	Lorca Telecom Bondco SA 4.00% 18/09/2027	3.411.594	0,35

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>SPANIEN (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	2.000.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	1.763.470	0,18	GBP	3.028.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	3.583.172	0,36
EUR	1.242.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	1.238.380	0,13	GBP	3.679.000	Deuce Finco plc 5.50% 15/06/2027	4.167.944	0,42
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>10.559.583</b>	<b>1,09</b>	EUR	3.308.000	EC Finance plc 3.00% 15/10/2026	3.258.391	0,33
<b>SCHWEDEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	4.200.000	Intrum AB 3.13% 15/07/2024	4.179.735	0,43	USD	4.639.224	Enquest plc 7.00% 15/10/2023	4.105.525	0,42
EUR	1.704.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	1.599.419	0,16	GBP	3.919.000	GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022	4.696.732	0,47
EUR	2.449.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	2.305.480	0,24	EUR	6.500.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	6.893.141	0,70
EUR	1.270.000	Verisure Holding AB 3.25% 15/02/2027	1.195.574	0,12	GBP	2.920.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	4.076.708	0,42
EUR	7.682.000	Verisure Holding AB 3.50% 15/05/2023	7.687.533	0,78	EUR	10.300.000	HSBC Holdings plc Perp FRN	10.371.733	1,06
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>16.967.741</b>	<b>1,73</b>	GBP	3.848.000	Iceland Bondco plc 4.63% 15/03/2025	4.097.367	0,42
<b>SCHWEIZ</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	2.571.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	2.314.160	0,24	EUR	1.840.000	Imperial Brands Finance plc 3.38% 26/02/2026	1.934.196	0,20
EUR	3.200.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	2.601.190	0,27	EUR	4.600.000	Ineos Finance plc 3.38% 31/03/2026	4.523.057	0,45
USD	4.500.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	4.196.707	0,43	EUR	1.537.000	Ineos Quattro Finance 2 plc 2.50% 15/01/2026	1.456.160	0,15
EUR	3.238.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	2.950.222	0,30	EUR	3.189.000	International Game Technology plc 3.50% 15/07/2024	3.264.424	0,33
USD	6.600.000	UBS Group AG Perp FRN	6.307.085	0,64	EUR	2.200.000	International Game Technology plc 3.50% 15/06/2026	2.220.675	0,23
USD	3.906.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	3.672.469	0,37	GBP	500.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	587.470	0,06
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>22.041.833</b>	<b>2,25</b>	GBP	3.100.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 3.88% 01/03/2023	3.642.316	0,37
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
GBP	6.845.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	8.995.384	0,92	EUR	2.000.000	Jaguar Land Rover Automotive plc 5.88% 15/11/2024	2.040.426	0,21
EUR	2.300.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	2.102.660	0,21	GBP	4.876.000	Jerrold Finco plc 4.88% 15/01/2026	5.574.162	0,56
GBP	3.478.000	Boparan Finance plc 7.63% 30/11/2025	3.356.850	0,34	GBP	2.344.000	Ladbrokes Group Finance plc 5.13% 16/09/2022	2.800.522	0,29
USD	4.988.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	4.519.338	0,46	GBP	2.166.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	2.501.834	0,25
EUR	2.968.000	British American Tobacco plc Perp FRN	2.709.040	0,27	GBP	836.000	Legal & General Group plc FRN 01/11/2050	1.016.763	0,10
GBP	403.500	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	530.918	0,05	GBP	7.133.000	Lloyds Banking Group PI Perp FRN	8.415.184	0,86
EUR	5.038.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	4.563.516	0,47	GBP	9.360.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	12.499.494	1,28
					GBP	1.100.000	M&G plc FRN 20/10/2051	1.422.717	0,15
					GBP	1.020.005	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	1.121.779	0,11
					GBP	1.440.397	Mitchells & Butlers Finance plc 5.57% 15/12/2030	1.862.409	0,19

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
GBP	113.990	Mitchells & Butlers Finance plc 5.97% 15/12/2023	137.939	0,01	GBP	2.767.000	Vmed O2 UK Financing 4.00% 31/01/2029	3.002.900	0,31
GBP	2.156.277	Mitchells & Butlers Finance plc 6.01% 15/12/2028	2.686.001	0,27	EUR	2.698.000	Vodafone Group plc FRN 27/08/2080	2.625.813	0,27
GBP	7.100.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	8.705.403	0,88	USD	3.500.000	Vodafone Group plc FRN 03/10/2078	3.247.098	0,33
EUR	5.733.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	5.209.124	0,53	GBP	1.444.000	WM Morrison Supermarkets plc 4.63% 08/12/2023	1.743.207	0,17
EUR	2.223.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	2.050.919	0,21	GBP	6.766.000	Zenith Finco plc 6.50% 30/06/2027	7.372.253	0,75
EUR	1.856.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	1.704.533	0,17	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			<b>245.170.858</b>	<b>24,96</b>
GBP	1.639.000	NatWest Group plc FRN 28/11/2031	1.808.008	0,18	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				
GBP	3.355.000	NatWest Group plc FRN 19/09/2026	3.941.078	0,40	USD	4.056.000	AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	3.827.534	0,39
GBP	3.901.000	Natwest Group plc Perp FRN	4.570.296	0,47	USD	2.928.000	Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	2.584.722	0,26
EUR	4.686.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	4.385.133	0,45	USD	2.140.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc. 5.45% 23/01/2039	2.249.046	0,23
EUR	2.140.000	Pinnacle Bidco plc 5.50% 15/02/2025	2.153.792	0,22	EUR	3.336.000	Ardagh Metal Packaging 2.00% 01/09/2028	3.082.899	0,31
GBP	3.864.000	Punch Finance plc 6.13% 30/06/2026	4.509.715	0,47	EUR	719.000	Ardagh Metal Packaging 3.00% 01/09/2029	642.906	0,07
GBP	3.100.000	Santander UK plc Perp 10.06%	6.451.531	0,66	USD	3.073.000	AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	2.453.442	0,25
EUR	3.787.000	Sherwood Financing plc 4.50% 15/11/2026	3.621.474	0,37	USD	1.375.000	AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	1.249.680	0,13
USD	12.875.000	SSE plc FRN 16/09/2077	11.638.458	1,19	EUR	2.420.000	Bank of America Corp. FRN 24/05/2032	2.250.711	0,23
EUR	2.047.000	Synthomer plc 3.88% 01/07/2025	2.056.551	0,21	USD	6.417.000	Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	5.302.304	0,54
GBP	2.864.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	3.225.839	0,33	EUR	2.453.000	Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	2.444.846	0,25
GBP	1.749.615	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	2.271.098	0,23	EUR	2.845.000	Catalent Pharma Solutions Inc. 2.38% 01/03/2028	2.670.391	0,27
GBP	5.599.695	Tesco Property Finance 3 plc 5.74% 13/04/2040	7.856.899	0,80	EUR	4.300.000	Coty Inc. 4.00% 15/04/2023	4.307.131	0,44
GBP	2.010.256	Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	2.806.653	0,29	EUR	5.214.000	Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	4.879.797	0,49
GBP	1.940.000	Thames Water Kemble Finance plc 4.63% 19/05/2026	2.217.741	0,23	EUR	1.233.000	Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	962.224	0,10
GBP	2.500.000	Thames Water Utilities Finance FRN 13/09/2030	3.001.815	0,31	EUR	3.943.000	Fidelity National Information Services Inc. 1.00% 03/12/2028	3.761.002	0,38
EUR	3.674.000	Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	3.492.190	0,36	EUR	5.496.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.02% 06/03/2024	5.570.801	0,57
GBP	1.320.000	Travis Perkins 4.50% 07/09/2023	1.587.091	0,16	EUR	3.073.000	Ford Motor Credit Company LLC 3.25% 15/09/2025	3.124.382	0,32
GBP	2.071.000	Travis Perkins plc 3.75% 17/02/2026	2.434.484	0,24	USD	1.179.000	Goodman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	1.060.566	0,11
EUR	2.040.000	Victoria plc 3.63% 26/08/2026	1.966.829	0,20	EUR	3.763.000	Iqvia Inc. 2.25% 15/01/2028	3.582.188	0,37
EUR	1.922.000	Vmed O2 UK Financing 3.25% 31/01/2031	1.776.986	0,18	EUR	3.334.000	Iqvia Inc. 2.88% 15/06/2028	3.224.229	0,33

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*			
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>						
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>						
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>						
USD	1.840.000	JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	1.508.778	0,15	GBP	11.400.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	12.965.035	1,32	
USD	4.829.000	JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	3.979.628	0,41	<b>Deutschland, insgesamt</b>			<b>12.965.035</b>	<b>1,32</b>	
EUR	1.432.000	Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	1.465.313	0,15	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>				<b>12.965.035</b>	<b>1,32</b>
GBP	5.498.000	Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	6.832.982	0,70	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>				<b>820.491.945</b>	<b>83,64</b>
USD	2.929.000	Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	2.662.337	0,27	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>					
GBP	325.000	MPT Operating Partnership 2.55% 05/12/2023	380.813	0,04	<b>Anleihen</b>					
EUR	1.242.000	Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	1.317.408	0,13	<b>AUSTRALIEN</b>					
EUR	4.000.000	Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	4.356.755	0,45	USD	9.082.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027	8.383.292	0,86	
EUR	640.000	Netflix Inc. 4.63% 15/05/2029	724.326	0,07	USD	3.640.000	Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	3.379.704	0,34	
USD	1.330.000	Occidental Petroleum Corp. 5.88% 01/09/2025	1.271.100	0,13	<b>Australien, insgesamt</b>			<b>11.762.996</b>	<b>1,20</b>	
USD	1.195.000	Occidental Petroleum Corp. 6.63% 01/09/2030	1.233.772	0,13	<b>BERMUDAS</b>					
USD	1.230.000	Occidental Petroleum Corp. 8.00% 15/07/2025	1.241.967	0,13	USD	3.251.000	Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	2.988.073	0,30	
USD	775.000	Occidental Petroleum Corp. 8.50% 15/07/2027	827.027	0,08	USD	11.721.000	Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	11.001.474	1,13	
USD	1.430.000	Occidental Petroleum Corp. 8.88% 15/07/2030	1.656.241	0,17	<b>Bermudas, insgesamt</b>			<b>13.989.547</b>	<b>1,43</b>	
EUR	1.278.000	Olympus Water USA 5.38% 01/10/2029	1.122.566	0,11	<b>KANADA</b>					
USD	2.478.000	Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	2.155.198	0,22	USD	2.062.000	Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	1.839.391	0,19	
EUR	1.710.000	Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	1.622.151	0,17	<b>Kanada, insgesamt</b>			<b>1.839.391</b>	<b>0,19</b>	
EUR	2.176.000	Scientific Games International Inc. 5.50% 15/02/2026	2.238.560	0,23	<b>DÄNEMARK</b>					
EUR	1.095.000	Silgan Holdings Inc. 2.25% 01/06/2028	999.413	0,10	USD	2.205.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	1.805.197	0,18	
EUR	8.555.000	Silgan Holdings Inc. 3.25% 15/03/2025	8.525.058	0,87	<b>Dänemark, insgesamt</b>			<b>1.805.197</b>	<b>0,18</b>	
EUR	1.375.000	Southern Company FRN 15/09/2081	1.227.524	0,13	<b>FRANKREICH</b>					
GBP	3.925.000	Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	5.270.130	0,54	USD	6.211.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	5.309.184	0,54	
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>		<b>111.849.848</b>	<b>11,42</b>		USD	3.516.000	Credit Agricole SA Perp FRN	2.871.450	0,29	
<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>807.526.910</b>	<b>82,32</b>		<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>8.180.634</b>	<b>0,83</b>	

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>				
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>IRLAND</b>				
USD	3.856.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	3.556.276	0,36	1.028.076	BlackRock ICS Sterling Liquidity Fund	1.216.570	0,13
		<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>3.556.276</b>	<b>0,36</b>	10.772	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	9.681	0,00
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Irland, insgesamt</b>				
USD	4.470.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	3.779.760	0,39	330.540	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	32.467.733	3,31
USD	2.819.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	2.364.029	0,24	32.446	Insight Liquidity Funds plc	38.395	0,00
USD	6.619.000	Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	5.980.903	0,61	<b>Irland, insgesamt</b>			
USD	6.443.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	5.939.983	0,61	<b>33.732.379</b>			
USD	1.160.000	Occidental Petroleum Corp. 7.88% 15/09/2031	1.303.195	0,13	<b>Fonds, insgesamt</b>			
		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>19.367.870</b>	<b>1,98</b>	<b>33.732.379</b>			
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>60.501.911</b>				
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>60.501.911</b>				
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
<b>Anleihen</b>				<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
<b>PORTUGAL</b>				<b>(Gesamtkosten: EUR 952.520.070)</b>				
EUR	17.100.000	Banco Espirito Santo SA 4.00% 21/01/2099**	1.881.000	0,19	<b>33.732.379</b>			
		<b>Portugal, insgesamt</b>	<b>1.881.000</b>	<b>0,19</b>	<b>33.732.379</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				<b>33.732.379</b>				
EUR	2.527.000	BCP V Modular Services Finance II plc 6.75% 30/11/2029	2.305.374	0,24	<b>33.732.379</b>			
GBP	5.119.000	Pinewood Finance Company Limited 3.25% 30/09/2025	5.868.629	0,60	<b>33.732.379</b>			
GBP	2.009.000	Sherwood Financing plc 6.00% 15/11/2026	2.258.808	0,23	<b>33.732.379</b>			
		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>10.432.811</b>	<b>1,07</b>	<b>33.732.379</b>			
<b>Anleihen, insgesamt</b>				<b>12.313.811</b>				
<b>Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, insgesamt</b>				<b>12.313.811</b>				

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

\*\*Wertpapiere zum beizulegenden Zeitwert.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>AUSTRALIEN</b>				<b>DÄNEMARK (Fortsetzung)</b>			
EUR	274.000	APT Pipelines Limited 1.25% 15/03/2033		EUR	100.000	Danske Bank AS FRN 15/05/2031	
		240.924	0,54			94.352	0,21
USD	144.000	APT Pipelines Limited 4.25% 15/07/2027				<b>528.883</b>	<b>1,18</b>
		132.922	0,30				
EUR	100.000	Ausgrid Finance Pty Limited 0.88% 07/10/2031					
		88.139	0,20				
EUR	220.000	Ausgrid Finance Pty Limited 1.25% 30/07/2025					
		219.433	0,49				
EUR	228.000	AusNet Services Holdings Pty Ltd 0.63% 25/08/2030					
		203.570	0,46				
EUR	196.000	Goodman Australia 1.38% 27/09/2025					
		195.919	0,44				
GBP	210.000	Pacific National Finance Pty Limited 5.00% 19/09/2023					
		256.331	0,57				
USD	400.000	SGSP Australia Assets Pty Limited 3.25% 29/07/2026					
		356.525	0,80				
		<b>Australien, insgesamt</b>	<b>1.693.763</b>				
			<b>3,80</b>				
<b>BELGIEN</b>				<b>FINNLAND</b>			
EUR	188.000	Anheuser-Busch InBev SA 3.70% 02/04/2040		EUR	243.000	Nordea Bank Abp 0.50% 14/05/2027	
		226.661	0,51			234.102	0,52
EUR	300.000	Belfius Bank SA 0.00% 28/08/2026		EUR	643.000	OP Corporate Bank plc 0.10% 16/11/2027	
		284.196	0,64			596.397	1,34
EUR	200.000	Belfius Bank SA/ NV 0.13% 08/02/2028				<b>830.499</b>	<b>1,86</b>
		183.911	0,41				
EUR	200.000	Kbc Group NV Perp FRN					
		197.346	0,44				
		<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>892.114</b>				
			<b>2,00</b>				
<b>BERMUDAS</b>				<b>FRANKREICH</b>			
EUR	522.000	Bacardi Limited 2.75% 03/07/2023		EUR	600.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 0.25% 29/06/2028	
		534.806	1,19			554.300	1,24
		<b>Bermudas, insgesamt</b>	<b>534.806</b>			221.871	0,50
			<b>1,19</b>			173.381	0,39
<b>KAIMANINSELN</b>						482.365	1,08
GBP	730.000	Southern Water Services Limited 2.38% 28/05/2028		EUR	200.000	Electricite de France SA Perp FRN	
		844.436	1,88			180.256	0,40
USD	210.000	Tencent Holdings Limited 3.24% 03/06/2050		EUR	141.000	Faurecia SE 2.38% 15/06/2029	
		147.738	0,33			122.087	0,27
GBP	200.000	Thames Water Utilities Cayman Finance Limited 2.38% 03/05/2023		EUR	100.000	Holding d'infrastructures de Transport SASU 1.48% 18/01/2031	
		235.628	0,53			94.627	0,21
		<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.227.802</b>			144.838	0,32
			<b>2,74</b>			502.451	1,14
<b>DÄNEMARK</b>						<b>2.476.176</b>	<b>5,55</b>
EUR	441.000	Danske Bank AS 0.63% 26/05/2025					
		434.531	0,97				
				<b>DEUTSCHLAND</b>			
				EUR	300.000	Alstria office REIT-AG 0.50% 26/09/2025	
						281.879	0,62
				EUR	400.000	Amprion GmbH 0.63% 23/09/2033	
						336.534	0,75
				EUR	200.000	Bayer AG 1.00% 12/01/2036	
						165.819	0,37
				EUR	298.000	Commerzbank AG 0.50% 04/12/2026	
						287.077	0,64
				EUR	181.000	Commerzbank AG 1.00% 04/03/2026	
						178.967	0,40
				EUR	400.000	Commerzbank AG FRN 05/12/2030	
						409.933	0,92
				EUR	200.000	Deutsche Bank AG FRN 19/11/2030	
						187.208	0,42
				EUR	200.000	Deutsche Bank AG Perp FRN	
						204.764	0,46
				EUR	400.000	Hamburg Commercial Bank AG 0.38% 09/03/2026	
						387.022	0,87

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>DEUTSCHLAND (Fortsetzung)</b>				<b>LUXEMBURG (Fortsetzung)</b>					
EUR	160.000	Volkswagen Financial Services AG 0.13% 12/02/2027	147.086	0,33	EUR	300.000	Aroundtown SA 1.45% 09/07/2028	280.150	0,63
EUR	250.000	Volkswagen Leasing GmbH 0.38% 20/07/2026	235.257	0,52	GBP	100.000	Aroundtown SA 3.00% 16/10/2029	113.786	0,25
		<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>2.821.546</b>	<b>6,30</b>	EUR	456.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.21% 04/06/2026	452.639	1,01
<b>INDIEN</b>				<b>EUR</b>					
USD	334.000	Adani Ports & Special Economic Zone Limited 4.38% 03/07/2029	289.496	0,65	EUR	200.000	Grand City Properties SA Perp FRN	178.149	0,40
		<b>Indien, insgesamt</b>	<b>289.496</b>	<b>0,65</b>	EUR	368.000	P3 Group Sarl 1.63% 26/01/2029	337.301	0,76
<b>IRLAND</b>				<b>Luxemburg, insgesamt</b>					
EUR	396.000	AIB Group plc FRN 19/11/2029	387.299	0,87			<b>1.636.033</b>	<b>3,66</b>	
EUR	125.000	AIB Group plc FRN 30/05/2031	123.522	0,28	<b>MEXIKO</b>				
EUR	290.000	Bank of Ireland Group plc FRN 11/08/2031	269.319	0,60	EUR	125.000	America Movil SAB de CV FRN 06/09/2073	133.007	0,30
EUR	163.000	Eaton Capital Unlimi 0.58% 08/03/2030	149.696	0,34	EUR	200.000	Petroleos Mexicanos 3.75% 16/04/2026	191.103	0,43
		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>929.836</b>	<b>2,09</b>			<b>Mexiko, insgesamt</b>	<b>324.110</b>	<b>0,73</b>
<b>ITALIEN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>					
EUR	100.000	Aeroporti di Roma SpA 1.75% 30/07/2031	91.700	0,21	EUR	200.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN 29/06/2170	200.000	0,45
EUR	100.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.00% 04/12/2028	97.355	0,22	EUR	400.000	Cooperatieve Rabobank UA Perp FRN	403.701	0,90
EUR	140.000	Autostrade per l'Italia SpA 2.25% 25/01/2032	131.629	0,29	EUR	240.000	Digital Dutch Finco BV 1.50% 15/03/2030	221.314	0,50
EUR	220.000	Banco BPM SpA 2.50% 21/06/2024	224.825	0,50	GBP	213.000	E.ON International Finance BV 6.25% 03/06/2030	314.013	0,70
		<b>Italien, insgesamt</b>	<b>545.509</b>	<b>1,22</b>	EUR	200.000	ING Groep NV FRN 29/09/2028	185.642	0,42
<b>JERSEY - KANALINSELN</b>				<b>EUR</b>					
USD	535.221	Galaxy Pipeline Assets Bidco Limited 2.16% 31/03/2034	444.531	0,99	EUR	200.000	ING Groep NV FRN 16/02/2031	196.679	0,44
GBP	124.000	Hastings Group Finance plc 3.00% 24/05/2025	149.431	0,33	USD	400.000	ING Groep NV Perp FRN	313.899	0,70
EUR	136.000	Heathrow Funding Limited 1.13% 08/10/2030	123.605	0,27	EUR	100.000	Sagax Euro MTN BV 0.75% 26/01/2028	87.877	0,20
		<b>Jersey - Kanalinseln, insgesamt</b>	<b>717.567</b>	<b>1,59</b>	EUR	287.000	Stedin Holding NV Perp FRN	276.763	0,62
<b>LUXEMBURG</b>				<b>EUR</b>					
EUR	300.000	Aroundtown SA 0.38% 15/04/2027	274.008	0,61	EUR	169.000	Tennet Holding BV Perp FRN	169.681	0,38
					EUR	220.000	Thermo Fisher Scientific Finance BV 1.63% 18/10/2041	198.245	0,45
					EUR	300.000	Triodos Bank NV FRN 05/02/2032	283.408	0,64
					EUR	100.000	Volkswagen International Finance NV 4.13% 16/11/2038	119.905	0,27
					EUR	200.000	Volkswagen International Finance NV Perp 4.38%	199.483	0,45
							<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>3.170.610</b>	<b>7,12</b>

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>					
<b>NORWEGEN</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>					
EUR	325.000	DNB Bank ASA FRN 23/02/2029	296.391	0,66	EUR	233.000	Cadent Finance plc 0.75% 11/03/2032	206.943	0,46
		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>296.391</b>	<b>0,66</b>	GBP	100.000	Co-Operative Bank Finance FRN 06/04/2027	118.335	0,26
<b>SPANIEN</b>				GBP 130.000 GKN Holdings plc 5.38% 19/09/2022				155.798	0,35
EUR	200.000	Merlin Properties Socimi SA 1.38% 01/06/2030	176.347	0,40	EUR	648.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	687.193	1,54
EUR	100.000	Nortegas Energia Distribucion SAU 2.07% 28/09/2027	99.709	0,22	EUR	152.000	HBOS plc FRN 18/03/2030	161.193	0,36
		<b>Spanien, insgesamt</b>	<b>276.056</b>	<b>0,62</b>	GBP	500.000	HSBC Bank plc 5.38% 22/08/2033	698.066	1,56
<b>SCHWEDEN</b>				EUR 700.000 HSBC Holdings plc Perp FRN 704.875				1,58	
EUR	358.000	Sagax AB 1.13% 30/01/2027	336.028	0,75	USD	380.000	Imperial Brands Finance plc 3.50% 26/07/2026	334.252	0,75
EUR	100.000	Sagax AB 2.00% 17/01/2024	101.105	0,23	GBP	100.000	Imperial Brands Finance plc 5.50% 28/09/2026	128.278	0,29
		<b>Schweden, insgesamt</b>	<b>437.133</b>	<b>0,98</b>	GBP	126.000	Legal & General Group plc FRN 26/11/2049	145.536	0,33
<b>SCHWEIZ</b>				GBP 100.000 Legal & General Group plc FRN 01/11/2050				121.622	0,27
EUR	257.000	Credit Suisse AG 0.25% 01/09/2028	231.326	0,52	GBP	767.000	Lloyds Banking Group PI Perp FRN	904.872	2,03
EUR	260.000	Credit Suisse Group AG 0.63% 18/01/2033	211.347	0,47	GBP	250.000	Lloyds TSB Bank plc 7.63% 22/04/2025	333.854	0,75
USD	400.000	Credit Suisse Group AG Perp FRN	373.041	0,84	GBP	47.850	Marston's Issuer plc FRN 15/10/2027	52.625	0,12
EUR	308.000	UBS AG 0.50% 31/03/2031	280.626	0,63	GBP	300.000	National Grid plc 3.50% 16/10/2026	367.834	0,83
USD	200.000	UBS Group AG Perp FRN	181.103	0,41	EUR	500.000	Nationwide Building Society 0.25% 14/09/2028	454.311	1,02
USD	200.000	UBS Group Funding Switzerland AG Perp FRN	188.042	0,42	EUR	226.000	Natwest Group plc FRN 26/02/2030	208.506	0,47
		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>1.465.485</b>	<b>3,29</b>	EUR	149.000	NatWest Group plc FRN 14/09/2032	136.840	0,31
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>				GBP 130.000 NatWest Group plc FRN 28/11/2031				143.405	0,32
GBP	149.000	Anglian Water Osprey Financing plc 2.00% 31/07/2028	163.999	0,37	GBP	420.000	Natwest Group plc Perp FRN	492.060	1,10
GBP	225.000	Barclays Bank plc 5.75% 14/09/2026	295.685	0,66	EUR	313.000	NGG Finance plc FRN 05/09/2082	292.904	0,66
EUR	100.000	Barclays plc FRN 12/05/2032	91.420	0,20	GBP	100.000	RI Finance FRN 30/11/2043	124.261	0,28
GBP	300.000	BAT International Finance plc 2.25% 26/06/2028	320.718	0,72	GBP	150.000	Santander UK plc Perp 10.06%	312.171	0,70
USD	279.000	Bp Capital Markets plc Perp FRN	252.786	0,57	USD	940.000	SSE plc FRN 16/09/2077	849.720	1,90
GBP	44.833	Broadgate Financing plc 5.10% 05/04/2033	58.991	0,13	GBP	88.634	Telereal Securitisation plc 1.37% 10/12/2031	99.685	0,22
GBP	246.000	Bupa Finance plc 5.00% 25/04/2023	299.098	0,67	GBP	100.000	Telereal Securitisation plc FRN 10/12/2033	112.634	0,26
GBP	224.000	BUPA Finance plc Perp FRN	224.496	0,50	GBP	137.689	Telereal Securitisation plc 5.43% 10/12/2031	178.728	0,40
EUR	196.000	Cadent Finance plc 0.63% 19/03/2030	177.541	0,40	GBP	273.053	Tesco Property Finance 7.62% 13/07/2039	431.508	0,97

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH (Fortsetzung)</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
GBP	97.161 Tesco Property Finance 5 plc 5.66% 13/10/2041	135.652	0,30	EUR	134.000 Thermo Fisher Scientific Inc. 1.88% 01/10/2049	121.252	0,27
EUR	200.000 Thames Water Utilities Finance 0.19% 23/10/2023	198.683	0,45	GBP	295.000 Time Warner Cable Inc. 5.75% 02/06/2031	396.099	0,89
EUR	376.000 Thames Water Utilities Finance plc 0.88% 31/01/2028	357.393	0,80	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>		<b>5.111.214</b>	<b>11,46</b>
GBP	128.000 Virgin Money UK plc FRN 19/08/2031	142.893	0,32	<b>Anleihen, insgesamt</b>		<b>37.882.393</b>	<b>84,87</b>
<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>		<b>11.677.364</b>	<b>26,18</b>	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>DEUTSCHLAND</b>			
USD	326.000 AbbVie Inc. 4.25% 21/11/2049	307.637	0,69	GBP	600.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.88% 15/09/2026	682.370	1,53
USD	298.000 Amgen Inc. 3.00% 22/02/2029	263.063	0,59	<b>Deutschland, insgesamt</b>		<b>682.370</b>	<b>1,53</b>
USD	287.000 AT&T Inc. 2.55% 01/12/2033	229.138	0,51	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>			
USD	125.000 AT&T Inc. 4.30% 15/12/2042	113.607	0,25	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>		<b>38.564.763</b>	<b>86,40</b>
USD	150.000 Bank of America Corp. FRN 21/07/2032	119.809	0,27	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
USD	583.000 Bank of America Corp. FRN 22/04/2032	481.727	1,08	<b>Anleihen</b>			
EUR	160.000 Berkshire Hathaway Finance 1.50% 18/03/2030	159.469	0,36	<b>AUSTRALIEN</b>			
EUR	189.000 Digital Euro Finco LLC 1.13% 09/04/2028	176.886	0,40	USD	330.000 Woodside Finance Limited 4.50% 04/03/2029	306.401	0,69
EUR	118.000 Eli Lilly & Company 1.38% 14/09/2061	92.086	0,21	<b>Australien, insgesamt</b>		<b>306.401</b>	<b>0,69</b>
USD	106.000 Goldman USA Finance Three 3.70% 15/03/2028	95.352	0,21	<b>BERMUDAS</b>			
USD	100.000 JPMorgan Chase & Company FRN 08/11/2032	81.999	0,18	USD	320.000 Bacardi Limited 4.45% 15/05/2025	294.120	0,66
USD	451.000 JPMorgan Chase & Company FRN 22/04/2032	371.674	0,83	USD	333.000 Bacardi Limited 4.70% 15/05/2028	312.558	0,70
EUR	175.000 Kraft Heinz Foods Company 2.25% 25/05/2028	179.071	0,40	<b>Bermudas, insgesamt</b>		<b>606.678</b>	<b>1,36</b>
GBP	368.000 Kraft Heinz Foods Company 4.13% 01/07/2027	457.355	1,03	<b>KANADA</b>			
USD	255.000 Lowe's Cos Inc. 3.75% 01/04/2032	231.784	0,52	USD	128.000 Rogers Communications 3.80% 15/03/2032	114.181	0,26
EUR	548.000 Netflix Inc. 3.63% 15/06/2030	581.272	1,31	<b>Kanada, insgesamt</b>		<b>114.181</b>	<b>0,26</b>
EUR	100.000 Netflix Inc. 3.88% 15/11/2029	108.919	0,24				
EUR	70.000 Petroleos Mexicanos 5.50% 24/02/2025	73.322	0,16				
USD	219.000 Plains All American Pipeline LP 3.55% 15/12/2029	190.472	0,43				
EUR	172.000 Prologis Euro Finance LLC 1.00% 08/02/2029	163.164	0,37				
EUR	130.000 Southern Company FRN 15/09/2081	116.057	0,26				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Fund

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Nennwert	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*		
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere (Fortsetzung)</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>					
<b>Anleihen (Fortsetzung)</b>				<b>Fonds</b>					
<b>DÄNEMARK</b>				<b>IRLAND</b>					
USD	215.000	Danske Bank AS 1.55% 10/09/2027	176.017	0,39	178	BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier	17.525	0,04	
<b>Dänemark, insgesamt</b>			<b>176.017</b>	<b>0,39</b>	<b>Irland, insgesamt</b>			<b>17.525</b>	<b>0,04</b>
<b>FRANKREICH</b>				<b>Fonds, insgesamt</b>					
USD	500.000	BPCE SA 2.70% 01/10/2029	427.402	0,96	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>				
USD	293.000	Credit Agricole SA Perp FRN	239.288	0,54	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>				
<b>Frankreich, insgesamt</b>			<b>666.690</b>	<b>1,50</b>	<b>(Gesamtkosten: EUR 43.262.237)</b>				
<b>NIEDERLANDE</b>				<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>					
USD	50.000	Vonovia Finance BV 5.00% 02/10/2023	46.114	0,10					
<b>Niederlande, insgesamt</b>			<b>46.114</b>	<b>0,10</b>					
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>									
USD	391.000	Carrier Global Corp. 2.72% 15/02/2030	330.623	0,74					
USD	271.000	Jersey Central Power & Light Company 2.75% 01/03/2032	227.262	0,51					
USD	309.000	Magallanes Inc. 4.28% 15/03/2032	279.212	0,63					
USD	300.000	Magallanes Inc. 5.14% 15/03/2052	276.578	0,62					
<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>			<b>1.113.675</b>	<b>2,50</b>					
<b>Anleihen, insgesamt</b>			<b>3.029.756</b>	<b>6,80</b>					
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>				<b>3.029.756</b>	<b>6,80</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert EUR	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>BELGIEN</b>				<b>SCHWEDEN</b>			
74.110	KBC Group NV	4.845.312	3,91	143.484	Epiroc AB	2.797.937	2,26
	<b>Belgien, insgesamt</b>	<b>4.845.312</b>	<b>3,91</b>	127.870	Sandvik AB	2.478.666	2,00
				<b>Schweden, insgesamt</b>			
				<b>5.276.603</b>			
				<b>4,26</b>			
<b>DÄNEMARK</b>				<b>SCHWEIZ</b>			
18.126	Novo Nordisk A/S	1.824.919	1,47	9.205	Lonza Group AG - Reg	6.043.073	4,88
302.104	Tryg A/S	6.670.828	5,39	51.713	Nestle SA - Reg	6.070.713	4,90
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>8.495.747</b>	<b>6,86</b>	78.617	Novartis AG - Reg	6.238.432	5,05
				17.266 Roche Holding AG			
				18.759 Sika AG			
				373.975 UBS Group AG			
				<b>Schweiz, insgesamt</b>			
				<b>36.790.656</b>			
				<b>29,72</b>			
<b>FRANKREICH</b>				<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
40.208	Air Liquide SA	6.389.855	5,17	8.584	Linde plc	2.493.652	2,01
29.267	Compagnie de Saint-Gobain	1.588.320	1,28	<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>			
1.784	Kering	1.027.049	0,83	<b>2.493.652</b>			
1.814	Louis Vuitton Moët Hennessy SE	1.178.011	0,95	<b>2,01</b>			
31.577	Pernod-Ricard SA	6.293.296	5,08	<b>Aktien, insgesamt</b>			
101.775	Publicis Groupe SA	5.624.087	4,54	<b>120.948.668</b>			
3.785	Sanofi	350.150	0,28	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>			
8.414	Schneider Electric SE	1.280.274	1,03	<b>120.948.668</b>			
17.726	Teleperformance	6.138.513	4,96	<b>97,67</b>			
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>29.869.555</b>	<b>24,12</b>	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
				<b>Fonds</b>			
				<b>IRLAND</b>			
<b>DEUTSCHLAND</b>				59 BlackRock Institutional Cash Series Euro Liquidity Fund Premier			
88.296	Daimler Truck Holding AG	2.227.708	1,80			5.786	0,00
88.916	Mercedes-Benz Group AG - Reg	5.673.730	4,58	<b>Irland, insgesamt</b>			
33.785	Volkswagen AG Pfd	5.304.245	4,28	<b>5.786</b>			
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>13.205.683</b>	<b>10,66</b>	<b>0,00</b>			
				<b>Fonds, insgesamt</b>			
				<b>5.786</b>			
				<b>0,00</b>			
<b>ITALIEN</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
21.528	Moncler SpA	1.092.331	0,88	<b>5.786</b>			
	<b>Italien, insgesamt</b>	<b>1.092.331</b>	<b>0,88</b>	<b>0,00</b>			
<b>NIEDERLANDE</b>				<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
1.773	ASML Holding NV	1.081.530	0,87	<b>120.954.454</b>			
312.084	ING Groep NV	2.968.231	2,40	<b>97,67</b>			
22.608	Koninklijke DSM NV	3.673.800	2,97	<b>(Gesamtkosten: EUR 116.684.115)</b>			
625.106	Royal KPN NV	1.964.708	1,59	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
30.759	Wolters Kluwer NV	2.970.704	2,40				
	<b>Niederlande, insgesamt</b>	<b>12.658.973</b>	<b>10,23</b>				
<b>NORWEGEN</b>							
302.429	DNB Bank ASA	6.220.156	5,02				
	<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>6.220.156</b>	<b>5,02</b>				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KANADA</b>				<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
1.444	Shopify Inc. - A	976.086	0,78	25.771	Voya Financial Inc.	1.709.906	1,37
	<b>Kanada, insgesamt</b>	<b>976.086</b>	<b>0,78</b>		<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>116.898.321</b>	<b>93,37</b>
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>Aktien, insgesamt</b>			
26.049	Globalfoundries Inc.	1.625.979	1,30		<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>119.500.386</b>	<b>95,45</b>
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.625.979</b>	<b>1,30</b>			<b>119.500.386</b>	<b>95,45</b>
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>				<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren</b>			
17.522	Agco Corp.	2.558.738	2,04	<b>Fonds</b>			
3.440	Alphabet Inc. - A	9.567.844	7,64	<b>IRLAND</b>			
45.831	American Electric Power Company Inc.	4.572.559	3,65	3.521.563	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	3.521.563	2,81
11.627	Cirrus Logic Inc.	985.853	0,79		<b>Irland, insgesamt</b>	<b>3.521.563</b>	<b>2,81</b>
138.495	Cisco Systems Inc.	7.722.481	6,17	<b>Fonds, insgesamt</b>			
5.001	Coca Cola Company	310.062	0,25	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>			
16.148	Crowdstrike Holdings Inc. - A	3.666.888	2,93	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>			
71.398	CVS Health Corp.	7.226.191	5,78	<b>(Gesamtkosten: USD 114.568.752)</b>			
24.830	Darling International Inc.	1.995.835	1,59	<i>*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.</i>			
10.323	Doordash Inc. - A	1.209.752	0,97				
13.761	Doximity Inc.	716.810	0,57				
15.312	Exact Sciences Corp.	1.070.615	0,86				
40.980	Gap Inc.	576.998	0,46				
42.326	General Motors Company	1.851.339	1,48				
5.925	Herc Holdings Inc.	990.008	0,79				
37.291	Hilton Worldwide Holdings Inc.	5.658.536	4,52				
67.019	Koontor Brands Inc.	2.771.236	2,21				
9.730	Lam Research Corp.	5.230.946	4,17				
63.942	Livent Corp.	1.666.968	1,33				
6.337	Mastercard Inc. - A	2.264.717	1,81				
19.149	Microsoft Corp.	5.903.829	4,71				
10.877	Mirati Therapeutics Inc.	894.307	0,71				
28.359	Ncino Inc.	1.162.152	0,93				
32.820	Northern Trust Corp.	3.821.889	3,05				
174.366	Nov Inc.	3.419.317	2,73				
35.937	Ranpak Holdings Corp.	734.193	0,59				
22.279	Salesforce.com Inc.	4.730.278	3,78				
41.912	Schnitzer Steel Industries Inc.	2.176.909	1,74				
17.121	Starbucks Corp.	1.557.498	1,24				
60.055	State Street Corp.	5.231.992	4,18				
5.584	Svb Financial Group	3.123.969	2,50				
32.212	Teradata Corp.	1.587.729	1,27				
2.815	Teradyne Inc.	332.817	0,27				
27.277	Transunion	2.818.805	2,25				
12.057	Union Pacific Corp.	3.294.093	2,63				
28.164	United Parcel Service Inc.	6.040.051	4,83				
22.011	Vertex Pharmaceuticals Inc.	5.744.211	4,58				

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.



## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*	Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>				<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien</b>				<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>KAIMANINSELN</b>				<b>NIEDERLANDE</b>			
9.294	Sea Limited	1.113.328	1,12	5.274	Airbus SE	647.605	0,65
	<b>Kaimaninseln, insgesamt</b>	<b>1.113.328</b>	<b>1,12</b>	5.286	Koninklijke DSM NV	955.739	0,96
<b>DÄNEMARK</b>				<b>NORWEGEN</b>			
15.464	Novo Nordisk A/S	1.732.296	1,75	42.384	Equinor ASA	1.605.394	1,62
15.100	Orsted A/S	1.918.065	1,93		<b>Norwegen, insgesamt</b>	<b>1.605.394</b>	<b>1,62</b>
40.640	Tryg A/S	998.471	1,01	<b>SÜDKOREA</b>			
	<b>Dänemark, insgesamt</b>	<b>4.648.832</b>	<b>4,69</b>	61.568	Samsung Electronics Company Limited	3.535.448	3,58
<b>FINNLAND</b>				3.129	Samsung Sdi Company Limited	1.538.623	1,55
24.583	Upm-Kymmene Oyj	811.268	0,82		<b>Südkorea, insgesamt</b>	<b>5.074.071</b>	<b>5,13</b>
	<b>Finnland, insgesamt</b>	<b>811.268</b>	<b>0,82</b>	<b>SCHWEIZ</b>			
<b>FRANKREICH</b>				3.562	Roche Holding AG	1.418.413	1,43
6.436	Essilor International SA	1.190.877	1,20		<b>Schweiz, insgesamt</b>	<b>1.418.413</b>	<b>1,43</b>
12.265	Schneider Electric SE	2.076.475	2,09	<b>TAIWAN</b>			
	<b>Frankreich, insgesamt</b>	<b>3.267.352</b>	<b>3,29</b>	130.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Limited	2.708.744	2,73
<b>DEUTSCHLAND</b>					<b>Taiwan, insgesamt</b>	<b>2.708.744</b>	<b>2,73</b>
4.303	Adidas AG	1.014.521	1,02	<b>VEREINIGTES KÖNIGREICH</b>			
	<b>Deutschland, insgesamt</b>	<b>1.014.521</b>	<b>1,02</b>	21.243	Diageo plc	1.080.605	1,09
<b>INDIEN</b>				42.853	SSE PLC	986.546	1,00
76.123	HDFC Bank Limited	1.477.106	1,49		<b>Vereinigtes Königreich, insgesamt</b>	<b>2.067.151</b>	<b>2,09</b>
	<b>Indien, insgesamt</b>	<b>1.477.106</b>	<b>1,49</b>	<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
<b>INDONESIEN</b>				8.178	Abbott Laboratories	967.948	0,98
4.385.549	Bank Rakyat Indonesia	1.423.005	1,44	1.367	Adobe Systems Inc.	622.833	0,63
	<b>Indonesien, insgesamt</b>	<b>1.423.005</b>	<b>1,44</b>	1.870	Amazon.com Inc.	6.096.107	6,16
<b>IRLAND</b>				3.283	American Tower Corp.	824.755	0,83
8.183	CRH plc	330.960	0,33	3.421	Autodesk Inc.	733.291	0,74
23.746	Medtronic Inc.	2.634.619	2,66	14.935	Centene Corp.	1.257.378	1,27
9.234	Trane Technologies plc	1.410.032	1,42	20.341	Comcast Corp.	952.366	0,96
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>4.375.611</b>	<b>4,41</b>	3.400	Cooper Companies Inc.	1.419.806	1,43
<b>JAPAN</b>				5.763	Deere & Company	2.394.296	2,42
3.500	Keyence Corp.	1.650.875	1,67	6.321	Ecolab Inc.	1.116.035	1,13
8.700	Sony Corp.	912.470	0,92	9.860	Electronic Arts Inc.	1.247.389	1,26
12.300	Yaskawa Electric Corp.	487.947	0,49	4.961	Eli Lilly & Company	1.420.682	1,43
	<b>Japan, insgesamt</b>	<b>3.051.292</b>	<b>3,08</b>	6.078	Fidelity National Information Services Inc.	610.353	0,62

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

### Portfolioaufstellungen

(Fortsetzung)

Anzahl	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung (Fortsetzung)</b>			
<b>Aktien (Fortsetzung)</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN (Fortsetzung)</b>			
34.512	General Motors Company	1.509.555	1,52
5.062	IntercontinentalExchange Inc.	668.791	0,67
6.190	Intuit Inc.	2.976.399	2,99
4.359	JPMorgan Chase & Company	594.219	0,60
3.799	Mastercard Inc. - A	1.357.687	1,37
684	Mercadolibre Inc.	813.604	0,82
8.141	NextEra Energy Inc.	689.624	0,70
6.990	Nvidia Corp.	1.907.291	1,92
9.813	Paypal Holdings Inc.	1.134.873	1,15
14.445	Qualcomm Inc.	2.207.485	2,23
1.665	S&P Global Inc.	682.950	0,69
360	Stryker Corp.	96.246	0,10
2.866	Thermo Fisher Scientific Inc.	1.692.803	1,71
31.191	T-Mobile USA Inc.	4.003.365	4,04
1.151	Transunion	118.944	0,12
7.612	Trimble Navigation Limited	549.130	0,55
36.978	Uber Technologies Inc.	1.319.375	1,33
3.989	Union Pacific Corp.	1.089.835	1,10
17.278	Walt Disney Company	2.369.850	2,38
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>45.445.265</b>	<b>45,85</b>
	<b>Aktien, insgesamt</b>	<b>81.104.697</b>	<b>81,82</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>81.104.697</b>	<b>81,82</b>

### Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren

#### Fonds

##### IRLAND

4.651.928	BlackRock ICS US Dollar Liquidity Fund	4.651.928	4,69
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>4.651.928</b>	<b>4,69</b>
	<b>Fonds, insgesamt</b>	<b>4.651.928</b>	<b>4,69</b>
	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren, insgesamt</b>	<b>4.651.928</b>	<b>4,69</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>85.756.625</b>	<b>86,51</b>

(Gesamtkosten: USD 75.542.479)

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

## Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### Portfolioaufstellungen

zum 31. März 2022

Nennwert	Anlage	Marktwert USD	% des Netto- inventar- werts*
<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung</b>			
<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe</b>			
<b>IRLAND</b>			
28.231	Invesco Physical Gold ETC 0.00%	5.306.299	0,97
	<b>Irland, insgesamt</b>	<b>5.306.299</b>	<b>0,97</b>
	<b>Strukturierte Instrumente - Rohstoffe, insgesamt</b>	<b>5.306.299</b>	<b>0,97</b>
	<b>Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente mit amtlicher Börsennotierung, insgesamt</b>	<b>5.306.299</b>	<b>0,97</b>
<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere</b>			
<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente</b>			
<b>VEREINIGTE STAATEN</b>			
USD 17.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 12/04/2022	16.999.448	3,11
USD 39.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 05/05/2022	38.994.677	7,13
USD 78.500.000	United States Treasury Bill 0.00% 26/05/2022	78.467.454	14,34
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 16/06/2022	79.930.583	14,61
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 23/06/2022	79.913.424	14,61
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 30/06/2022	79.896.960	14,60
USD 80.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 07/07/2022	79.879.616	14,60
USD 50.000.000	United States Treasury Bill 0.00% 21/07/2022	49.897.410	9,12
	<b>Vereinigte Staaten, insgesamt</b>	<b>503.979.572</b>	<b>92,12</b>
	<b>Supranationale Einrichtungen, Regierungen und Kommunalbehörden, Schuldinstrumente, insgesamt</b>	<b>503.979.572</b>	<b>92,12</b>
	<b>Auf einem sonstigen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente sowie vor kurzem emittierte übertragbare Wertpapiere, insgesamt</b>	<b>503.979.572</b>	<b>92,12</b>
	<b>Wert der Anlagen, insgesamt</b>	<b>509.285.871</b>	<b>93,09</b>
<b>(Gesamtkosten: USD 508.936.615)</b>			

\*Geringfügige Abweichungen aufgrund von Rundungen.

Die beiliegenden Erläuterungen sind ein wesentlicher Teil dieses Abschlusses.

## Erläuterungen zum Abschluss

### 1 ALLGEMEINES

Threadneedle (Lux) (die „SICAV“) ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (*Société d'Investissement à Capital Variable*), die den Vorschriften von Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen unterliegt.

Die SICAV bietet Anlegern die Möglichkeit, Anlagen in separaten Teilfonds (die „Portfolios“) zu tätigen, die jeweils unterschiedliche Anlageziele haben und getrennt geführte Vermögensportfolios sind, die separate Wertpapiere umfassen. Jedes Portfolio kann eine oder mehrere entsprechende Anteilklassen (die „Anteilklassen“) haben. Die SICAV als Ganzes, einschließlich der bestehenden und aller künftigen Portfolios, ist eine ungeteilte juristische Person. Im Verhältnis zu Dritten, insbesondere in Bezug auf die Gläubiger der SICAV und im Verhältnis zwischen den Anteilhabern haftet jedoch jedes Portfolio ausschließlich für die ihm zuzurechnenden Verbindlichkeiten.

#### Wesentliche Ereignisse während des Geschäftsjahres:

##### Neue Verkaufsprospekte

Neue Verkaufsprospekte wurden im Juli und im November 2021 herausgegeben.

##### Reduzierung der Gebühren und Aufwendungen

Mit Wirkung vom 1. September 2021 wurden die Gebühren und Aufwendungen des Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend und des Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities Portfolios wie folgt reduziert:

Portfolio und Klasse	Bis 31. August 2021			Ab 1. September 2021		
	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend - Klasse I	0,75 %	0,20 %	0,95 %	0,50 %	0,15 %	0,65 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities - Klasse Z	0,55 %	0,25 %	0,80 %	0,55 %*	0,15 %	0,70 %

\*keine Änderung

Ab dem 1. Dezember 2021 wurden die Gebühren und Aufwendungen für die nachstehenden Anteilklassen des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolio wie folgt reduziert:

Klasse	Bis zum 30. November 2021			Ab dem 1. Dezember 2021		
	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER	Anlageverwaltungsgebühr	Betriebskosten	TER
A	1,75 %	0,30 %	2,05 %	1,00 %	0,25 %	1,25 %
D	2,25 %	0,30 %	2,55 %	1,25 %	0,25 %	1,50 %
I	0,80 %	0,20 %	1,00 %	0,80 %*	0,15 %	0,95 %
N	0,45 %	0,20 %	0,65 %	0,45 %*	0,15 %	0,60 %
Z	0,75 %	0,30 %	1,05 %	0,75 %*	0,25 %	1,00 %

\*keine Änderung

Siehe auch Erläuterung 5.

##### Schließung des Portfolios

Mit Wirkung vom 21. Mai 2021 befindet sich das Threadneedle (Lux) – STANLIB Africa Equity Portfolio in Liquidation und seine Anteile stehen nicht mehr zur Zeichnung zur Verfügung. Die Liquidation wurde notwendig, da Devisenkontrollen in Nigeria den freien Umtausch von Naira in andere Währungen verhindern. Die Aktienanlagen des Portfolios wurden veräußert, und eine erste Zahlung der Erlöse aus dem Verkauf der vollständig liquiden Anlagen in Höhe von etwa 75 % des Nettoinventarwerts des Portfolios an die Anteilhaber erfolgte im Juli 2021. Der verbleibende Teil der Erlöse aus den nigerianischen Aktien befindet sich derzeit in der Warteschlange und wartet auf einen Umtausch in USD. Zum 31. März 2022 hielt das Portfolio 27 Positionen in nigerianischen Naira, die auf eine Umwandlung in USD warten.

##### Aufgelegte Anteilklassen

Im Berichtsjahr zum 31. März 2022 wurden folgende Anteilklassen aufgelegt:

Anteilklasse	Portfolio	Auflegungsdatum
IEP	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	8. April 2021
ZE	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	11. November 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	11. November 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	11. November 2021
ISC	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	29. Juli 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	11. November 2021
XU	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	17. März 2022
AE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10. Juni 2021

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Portfolio	Aufflegungsdatum
AEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10. Juni 2021
DE	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10. Juni 2021
DEH	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	10. Juni 2021
ZE	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	15. Juli 2021
XE	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	25. Februar 2022
ZE	Threadneedle (Lux) - European Select	14. Oktober 2021
ZU	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	11. November 2021
AE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5. August 2021
IE	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	5. August 2021

Zum 31. März 2022 lauten die aktiven Portfolios der SICAV wie folgt:

#### Die Anleiheportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) - European Social Bond
- Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond

#### Die Vermögensallokationsportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income

#### Die Aktienportfolios:

- Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Global Focus<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) - Global Select
- Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - American<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - American Select
- Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Asia Equities
- Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - European Select
- Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - Global Technology<sup>1</sup>
- Threadneedle (Lux) - UK Equities
- Threadneedle (Lux) - UK Equity Income

#### Die Absolute-Return-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha

<sup>1</sup>Diese Portfolios wurden zum 31. März 2022 von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen und sind in Hongkong für die Öffentlichkeit verfügbar.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 1 ALLGEMEINES

(Fortsetzung)

#### Die Extended-Alpha-Portfolios:

- Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha

#### Das Specialist-Portfolio:

- Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

### 2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Der Abschluss wurde im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung erstellt und vorgelegt, die für als OGAW (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) zugelassene Fonds gelten, und seine Erstellung erfordert Schätzungen und Annahmen seitens des Fondsmanagements, welche die im Abschluss und den Erläuterungen ausgewiesenen Beträge beeinflussen. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

Der Abschluss wird auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Portfolios erstellt, die zum 31. März 2022 berechnet werden. Der letzte offizielle Handelsnettoinventarwert der entsprechenden Portfolios wurde zum 31. März 2022 berechnet.

Der Abschluss wird mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity Portfolio, das am 21. Mai 2021 aufgelöst wurde, im Einklang mit den Luxemburger rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf Investmentfonds nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt. Dementsprechend wurden der Abschluss für dieses Portfolio nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, und alle zusätzlichen Kosten im Zusammenhang mit der Schließung dieses Portfolios trägt die Verwaltungsgesellschaft.

#### I) Bewertung der Wertpapiere

Übertragbare Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und Finanzwerte, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden zu ihrem letzten Börsenkurs am entsprechenden Markt zum Zeitpunkt der Schließung des Marktes bewertet. Falls die Kurse dieser Wertpapiere nicht für deren fairen Marktwert repräsentativ sind, werden sie zu dem beizulegenden Zeitwert ausgewiesen, zu dem sie sich erwartungsgemäß wiederverkaufen lassen und den der Verwaltungsrat nach Treu und Glauben festlegt oder gemäß seinen Anweisungen festlegen lässt.

Die festverzinslichen Wertpapiere, die nicht auf diesen Märkten gehandelt werden, werden zum zuletzt verfügbaren Kurs, zu den Zinsgegenwerten der vom Verwaltungsrat genehmigten Händler oder Kursstellungsdienste oder zu einem anderen vom Verwaltungsrat für angemessen erachteten Kurs bewertet.

Geldmarktinstrumente (oder sonstige Instrumente, die in der Rechtsordnung, in der das Instrument gehalten wird, den Marktgrundsätzen entsprechen) mit einer Restlaufzeit von maximal 90 Tagen werden gemäß der Restbuchwertmethode (amortized cost method) bewertet, die in etwa den Marktwert widerspiegelt. Bei dieser Bewertungsmethode werden die entsprechenden Portfolioanlagen zu ihren Anschaffungskosten bzw. zu dem letzten, vor Beginn der 90-Tage-Frist verfügbaren Marktwert (sofern ein Instrument am Kaufdatum ursprünglich eine Restlaufzeit von mehr als 90 Tagen hatte), angepasst um die Abschreibung des Aufschlags oder des Abschlags, und nicht zum Marktwert bewertet.

Die Anteile offener Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA“) werden zu ihrem zuletzt festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert (der „Nettoinventarwert“) bewertet. Falls die Preise dieser Vermögenswerte für deren beizulegenden Marktwert nicht repräsentativ sind, werden sie von der SICAV nach Treu und Glauben festgelegt. Die Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letztverfügbaren Kurswert bewertet.

Der Verwaltungsrat der SICAV (der „Verwaltungsrat“) kann in eigenem Ermessen die Verwendung anderer Bewertungsmethoden genehmigen, wenn er der Ansicht ist, dass sie den beizulegenden Zeitwert eines Vermögenswerts der SICAV besser wiedergeben.

#### II) Devisenterminkontrakte

Zur Absicherung besonderer Währungsrisiken bzw. zur Anlage in anderen Währungen darf die SICAV Devisenterminkontrakte eingehen. Zum Ende des Geschäftsjahres wurden die offenen Devisenterminkontrakte zu den Terminkursen bewertet, die für die Restlaufzeit bis Fälligkeit gültig waren. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Devisenterminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2022 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 9 aufgeführt.

#### III) Terminkontrakte

Die SICAV kann Devisenterminkontrakte eingehen. Offene Terminkontrakte werden zu den Kursen an der Börse bewertet, an denen die Kontrakte gehandelt werden. Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus Terminkontrakten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2022 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 11 aufgeführt.

#### IV) Swaps

Die SICAV darf Aktienswaps, Zinsswaps („IRS“), Credit Default Swaps („CDS“) und Total Return Swaps („TRS“) abschließen. Zinsswaps (IRS) werden auf Basis ihres Marktwerts bewertet, der sich aus der gültigen Zinskurve ergibt. Kreditausfallswaps werden unter Bezug auf den aktuellen Nettowert des erwarteten zukünftigen Cashflows basierend auf den marktüblichen Zinssätzen und der an dem Markt zu erwartenden Ausfall- und Rückgewinnungsrate der zugrunde liegenden Vermögenswerte bewertet. Eine gegebenenfalls von der SICAV geleistete Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Vermögenswert ausgewiesen. Eine gegebenenfalls von der SICAV erhaltene Vorauszahlung wird in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen. TRS werden anhand ihres Marktwerts bewertet, der auf dem Marktwert des Basiswerts basiert.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 2 ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

(Fortsetzung)

Die Nettobewegung der entstandenen nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Swap-Geschäften ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen. Die zum 31. März 2022 offenen Kontrakte sind in Erläuterung 10 aufgeführt. Die ggf. auf Swap-Short-Positionen zahlbaren Dividenden werden in der Aufstellung des Nettovermögens als Verbindlichkeit ausgewiesen.

#### V) Optionen

An einem geregelten Markt gehandelte Optionen werden zum Marktpreis am Tag der Bewertung bewertet. Diese zum 31. März 2022 offenen Optionen sind dem Anlageverzeichnis zu entnehmen. Over the Counter („OTC“)-Optionen werden zu Preisen bewertet, die von externen Preisagenturen/Modellen bereitgestellt werden. Diese zum 31. März 2022 offenen Optionen sind in Erläuterung 12 aufgeführt. Zum Zeitpunkt der Berichterstellung durch die Bewertung von Optionsgeschäften entstandene nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

#### VI) Währungsumrechnung

Die Konten eines Portfolios werden in der Währung geführt, in der dessen Nettovermögen ausgedrückt ist. Auf diese Währung (die „Basiswährung“) lauten auch jeweils die Aufstellung des Nettovermögens, die Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens sowie das Anlageverzeichnis.

Während des Jahres wurden Transaktionen, Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der Wechselkurse verbucht, die an dem Datum, an dem sie erfolgten oder im Portfolio anfielen, gültig waren.

Zum Datum der Aufstellung des Nettovermögens werden monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf eine andere Währung als die Basiswährung lauten, auf Basis der an diesem Datum geltenden Wechselkurse in die Basiswährung umgerechnet. Wechselkursdifferenzen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens ausgewiesen.

Die konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens sowie die konsolidierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens werden in USD vorgelegt. Sie beruhen auf den Wechselkursen, die am Datum der Aufstellung des Nettovermögens gültig waren. Wechselkurse zum 31. März 2022: 1 USD = 1,331647 AUD, 1 USD = 0,898755 EUR, 1 USD = 0,759503 GBP, 1 USD = 0,920250 CHF, 1 USD = 9,319404 SEK, 1 USD = 6,685341 DKK, 1 USD = 8,744010 NOK, 1 USD = 7,831406 HKD und 1 USD = 1,353350 SGD.

Die Differenz zwischen dem Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums, das zu den zu Beginn des Geschäftsjahres geltenden Wechselkursen ausgewiesen ist, und dessen Wert am Ende des Geschäftsjahres wird als Umrechnungsanpassung in der konsolidierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Wechselkursdifferenzen“ ausgewiesen.

#### VII) Bankguthaben

Das in der Aufstellung des Nettovermögens angegebene Bankguthaben beinhaltet auch die Margins auf Terminkontrakten und die von den Portfolios gezahlten Barsicherheiten für Swappgeschäfte und Devisenterminkontrakte.

Bankguthaben und Margins auf Terminkontrakten werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

#### VIII) Termineinlagen

Termineinlagen werden zu Anschaffungskosten bewertet, was in etwa dem Marktwert entspricht.

#### IX) Anlagetransaktionen und Anlageertrag

Wertpapiere werden zum Anschaffungspreis und ggf. auf der Grundlage der am Kauftag geltenden Wechselkurse ausgewiesen.

Einnahmen aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf der Basis der Durchschnittskostenmethode ermittelt. Anlagetransaktionen werden zum Transaktionsdatum abgerechnet. Dividenden werden zum Ex-Dividenden-Datum abgerechnet. Zinserträge werden bei ihrem Anfallen ausgewiesen. Abschläge/Aufschläge auf Nullkuponanleihen werden als Anpassungen mit den Zinserträgen verrechnet.

Zinsen, Dividenden und Kapitalerträge auf Wertpapiere können in bestimmten Ländern einer Quellen- oder Kapitalertragssteuer unterliegen.

#### X) Ausschüttungspolitik

Gemäß der Ausschüttungspolitik der SICAV sind für keine der Anteilklassen der Portfolios Ausschüttungen vorgesehen, mit Ausnahme der Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet. Sämtliche Nettoerträge der Portfolios werden thesauriert und innerhalb der betreffenden Portfolios und der betreffenden Klasse wieder angelegt. Die SICAV beabsichtigt, für die Klassen, deren Bezeichnung mit „C“, „M“, „P“ oder „T“ endet, regelmäßig (mindestens jährlich) Ausschüttungen in einer vom Verwaltungsrat festzulegenden Höhe durchzuführen. Die Anteilinhaber dieser Anteilklassen können sich entweder für eine Ausschüttung oder eine Wiederanlage der Erträge in dieselbe Anteilklasse entscheiden.

#### XI) Rückvergütungen von Anlageverwaltungsgebühren

Überkreuzbeteiligungen und Anlagen in anderen Fonds von Columbia Threadneedle werden entweder in nicht gebührenpflichtigen Anteilklassen getätigt oder die gezahlte Verwaltungsgebühr wird vollständig zurückerstattet. Bitte lesen Sie auch Erläuterung 18, die Einzelheiten zu Überkreuzbeteiligungen enthält.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 3 BESTEUERUNG

Gemäß der aktuellen Gesetzgebung und Praxis unterliegt die SICAV keiner luxemburgischen Ertrags- oder Kapitalertragssteuer auf den realisierten Wertzuwachs ihrer Vermögenswerte, und auch die durch die SICAV ausgeschütteten Dividenden unterliegen keiner luxemburgischen Quellensteuer.

Gemäß den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt die SICAV im Großherzogtum Luxemburg einer jährlichen Steuer („*taxe d'abonnement*“) in Höhe von 0,05 %, die sich aus ihrem Nettoinventarwert am Ende eines Quartals herleitet und vierteljährlich abzuführen ist. Auf die von der SICAV gehaltenen Vermögenswerte anderer OGAW, die bereits dieser luxemburgischen Steuer unterliegen, fällt keine Steuer an.

Für institutionelle Anteilklassen wird am letzten Tag eines jeden Kalenderquartals in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung eine verringerte jährliche Zeichnungssteuer von 0,01 % auf den Nettoinventarwert erhoben.

Auch für Portfolios, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumenten und der Platzierung von Einlagen bei Kreditinstituten besteht, gilt eine verringerte Steuer von 0,01 %. Diese Steuer fällt ebenfalls nicht auf den Anteil des Vermögens der SICAV an, der gegebenenfalls in anderen luxemburgischen OGAW angelegt ist.

Zur Klarstellung. Diese *taxe d'abonnement* ist Bestandteil der Betriebskosten der SICAV.

Obwohl die realisierten Kapitalerträge der SICAV, ganz gleich ob kurz- oder langfristig, in Luxemburg nicht versteuert werden müssen, können sie in den Herkunftsländern der Steuerpflicht unterliegen.

### 4 SONSTIGE GEBÜHREN

Bei den sonstigen Gebühren handelt es sich überwiegend um italienische Steuern.

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

Die SICAV kann im Namen der verschiedenen Portfolios Kreditaufnahmen (vorbehaltlich der Beschränkungen unter „Anlagebeschränkungen“ in Anhang A des Verkaufsprospekts) sowie den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Devisen oder sonstigen Finanzinstrumenten über die Threadneedle Asset Management Limited („TAML“), eine verbundene Partei und ihre verbundenen Unternehmen tätigen, sofern diese Geschäfte nach dem Fremdvergleichsprinzip und zu üblichen Handelsbedingungen ausgeführt werden und im besten Interesse der betreffenden Portfolios und ihrer Anteilinhaber liegen.

Für das Geschäftsjahr zum 31. März 2022 ging die SICAV keine Transaktionen mit verbundenen Personen ein.

Die SICAV hat Threadneedle Management Luxembourg S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“) gemäß Kapitel 15 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung zu ihrer bezeichneten Verwaltungsgesellschaft ernannt. Gemäß der Verwaltungsgesellschaftsvereinbarung erbringt die Verwaltungsgesellschaft vorbehaltlich der allgemeinen Aufsicht und Kontrolle durch den Verwaltungsrat Anlageverwaltungs-, Verwaltungs- und Marketingdienstleistungen für die SICAV.

Weder die Verwaltungsgesellschaft noch TAML haben Provisionen für Maklertransaktionen erhalten.

Gewisse Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder der Verwaltungsgesellschaft, der SICAV und von anderen Unternehmen von Columbia Threadneedle Group sind auch Führungskräfte und/oder Verwaltungsratsmitglieder von TAML.

Die Verwaltungsgesellschaft hat (im Namen der SICAV) bestimmte Marketing- bzw. Vertriebsfunktionen an weitere Unternehmen von Columbia Threadneedle Group übertragen. Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Anlageverwaltungsdienste eine monatliche Gebühr zu dem in dieser Erläuterung aufgeführten Jahressatz, ausgedrückt als Prozentsatz des durchschnittlichen täglichen Nettovermögens der einzelnen Portfolios. Die Verwaltungsgesellschaft ist verpflichtet, aus dieser Gebühr die Untervertriebsgebühren zu zahlen. Einige der Unterberater sind verbundene Parteien.

Wie in Erläuterung 8 dargelegt, kann die Verwaltungsgesellschaft auch für alle A-, D-, I- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, für alle J- und Y-Anteile des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und für alle A-, D-, I-, L- und Z-Anteile des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio Performancegebühren erhalten.

Sämtliche durch den Betrieb der SICAV entstandenen und nachstehend definierten Kosten (nachstehend die „Betriebskosten“, „Anlageverwaltungsgebühr“ oder „Portfoliogeühren“, zusammen die „Aufwendungen“) werden zu den in den Tabellen ab Seite 241 aufgeführten Sätzen festgelegt. Alle Aufwendungen fallen auf der Grundlage des Nettoinventarwerts der entsprechenden Anteilklasse im entsprechenden Portfolio täglich an.

Die Betriebskosten beinhalten unter anderem Steuern, Aufwendungen für Rechtsberatungs- und Prüfungsdienste, Druckkosten für Vollmachtsformulare, Aktienzertifikate, Berichte und Mitteilungen an die Anteilinhaber, Verkaufsprospekte und die wesentlichen Informationen für den Anleger (KIID) sowie weitere Werbekosten, Gebühren und Kosten der Verwahrstelle und deren Korrespondenten, der Domizilstelle, Verwaltungsstelle, Register- und Transferstelle sowie der Zahlstelle, Aufwendungen für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen, Registrierungsgebühren und Aufwendungen in verschiedenen Rechtsgebieten, Notierungsgebühren, Gebühren für nicht verbundene Verwaltungsratsmitglieder der SICAV, Aufwendungen für die Verwaltungsratsmitglieder und Führungskräfte der SICAV und die Unterberater für deren Teilnahme an Sitzungen des Verwaltungsrates und Versammlungen der Anteilinhaber der SICAV, Übersetzungskosten, Rechnungslegungs- und Kursermittlungskosten (einschließlich der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil), Versicherung, Rechtsstreitigkeiten und sonstige außerordentliche oder nicht wiederkehrende Aufwendungen und alle sonstigen Aufwendungen, die durch die SICAV ordnungsgemäß zu entrichten sind. In den Betriebskosten ist auch die an die Verwaltungsgesellschaft zahlbare Servicegebühr enthalten. Die Verwaltungsgesellschaft trägt den Teil der Betriebskosten, der über dem Jahressatz liegt. Hingegen ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, einen Betrag einzubehalten, um den der Jahressatz für Betriebskosten die der SICAV tatsächlich entstandenen Aufwendungen übersteigt.



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Darüber hinaus hat die Verwaltungsgesellschaft Anspruch auf eine Anlageverwaltungsgebühr (die „Anlageverwaltungsgebühr“), die in den Tabellen ab Seite 241 näher beschrieben wird und die täglich anfällt und monatlich zahlbar ist. Für die X-Anteile und 4-Anteile wird keine Anlageverwaltungsgebühr fällig. Zur Klarstellung: Die Betriebskosten umfassen weder Anlageverwaltungsgebühren noch Performancegebühren, die hiervon unabhängig sind und gesondert erhoben werden.

Die SICAV bietet B-Anteile für das Threadneedle (Lux) - Global Technology Portfolio an.

Bei diesen B-Anteilen handelt es sich um eine überkommene Anteilklasse, die nur für bestehende Anteilinhaber für weitere Zeichnungen verfügbar ist, und für sie wird kein Ausgabeaufschlag erhoben.

#### A-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Anleiheportfolios	Max. 3,0 %	Max. 0,75 %
Aktienportfolios und Vermögensallokationsportfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Absolute-Return-Portfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Extended-Alpha-Portfolios	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %
Specialist-Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage-		
		verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,60 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,90 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,30 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,90 %	0,25 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	1,25 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,35 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	1,25 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	1,50 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,55 %	0,15 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,50 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	1,65 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	1,50 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,30 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,90 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	1,50 %	0,35 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,00 % <sup>1</sup>	0,25 % <sup>2</sup>	USD

#### B-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Nil

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,35 %	USD

#### D-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 1,00 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	1,35 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	1,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,45 %	0,30 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	1,45 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	1,20 %	0,25 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset income	2,00 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	1,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	2,00 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,50 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,85 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	2,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	2,00 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	2,25 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	2,25 %	0,35 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	2,25 %	0,30 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	1,45 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	2,00 %	0,35 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	2,00 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	1,25 % <sup>3</sup>	0,25 % <sup>2</sup>	USD

#### I-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,50 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	EUR

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,65 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,15 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,65 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,20 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,65 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,70 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,80 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,80 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,25 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,65 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,50 % <sup>4</sup>	0,15 % <sup>5</sup>	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,85 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,65 %	0,20 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,20 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,80 %	0,15 % <sup>6</sup>	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### J-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Eine Performancegebühr wird auch für J-Anteile erhoben, wie im Abschnitt „Performancegebühr“ im Hauptteil des Verkaufsprospekts beschrieben.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,25 %	0,20 %	EUR

#### L-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
<b>Vermögensallokationsportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,50 %	0,20 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,35 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,50 %	0,20 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,20 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,375 %	0,20 %	EUR

#### N-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,10 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,55 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,08 %	GBP

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,45 %	0,15 % <sup>6</sup>	USD

#### S-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,50 %	0,30 %	USD

#### T-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,55 %	0,10 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,90 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,60 %	0,12 %	GBP

#### W-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	1,00 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	1,00 %	0,30 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	1,40 %	0,35 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,15 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,40 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,40 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	1,55 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	1,65 %	0,35 %	USD

### X-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	Max. 0,75 %

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,15 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,15 %	USD
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,15 %	EUR
<b>Specialist-Portfolio</b>			
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,15 %	USD

### Y-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	Max. 0,75 %

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage-		Basiswährung
		verwaltungsgebühr	Betriebskosten	
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,35 %	0,25 %	EUR

### Z-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	5,00 %	Max. 0,75 %

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage-		Basiswährung
		verwaltungsgebühr	Betriebskosten	
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	0,40 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,40 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	0,40 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Social Bond	0,30 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	0,40 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	0,60 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	0,40 %	0,25 %	USD
<b>Vermögensallokationsportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	0,75 %	0,30 %	USD
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Focus	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,25 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	0,75 %	0,35 %	USD
	Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	0,30 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,30 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,35 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	0,75 %	0,30 %	USD



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Global Technology	0,85 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,30 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*	1,25 %	0,35 %	USD
<b>Absolute-Return-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,55 %	0,15 % <sup>7</sup>	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	0,45 %	0,25 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	0,75 %	0,30 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,30 %	USD
<b>Specialist-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	0,75 %	0,25 % <sup>2</sup>	USD

### 1-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 5,0 %	k. A.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	1,00 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	1,20 %	0,18 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,50 %	0,21 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,50 %	0,17 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,50 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,50 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,30 %	0,23 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,50 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,50 %	0,22 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	1,50 %	0,14 %	GBP
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	1,00 %	0,17 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	1,50 %	0,19 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

#### 2-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,07 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,06 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,06 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,07 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,06 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,08 %	USD

#### 3-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	Max. 3,0 %	k. A.

Bei den angegebenen Ausgabeaufschlägen handelt es sich um Höchstsätze, auf die die Vertriebsstellen oder die Untervertriebsstellen in Abhängigkeit von dem jeweiligen Zeichnungsbetrag bzw. angesichts örtlicher Marktgegebenheiten ganz oder teilweise verzichten können.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,17 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,18 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,15 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,20 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,19 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,20 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,18 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,12 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,13 %	GBP
<b>Extended-Alpha-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,19 %	USD

### 4-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,07 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>			
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,08 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,07 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>			
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,06 %	EUR

### 8-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio-typ	Name des Portfolios	Anlage-verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,75 %	0,11 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	1,00 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	1,00 %	0,10 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	1,00 %	0,10 %	USD

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 5 TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PARTEIEN

(Fortsetzung)

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Aktienportfolios</b>				
<i>(Fortsetzung)</i>				
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	1,00 %	0,13 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	1,00 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	1,00 %	0,13 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	1,00 %	0,10 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	1,00 %	0,11 %	EUR
<b>Absolute-Return-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	0,50 %	0,10 %	EUR
<b>Extended-Alpha-Portfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	0,75 %	0,12 %	USD

### 9-ANTEILE:

Portfolio(s)	Ausgabeaufschlag in % des Anlagebetrages	Umtauschgebühr
Jedes unten aufgeführte Portfolio	k. A.	k. A.

Portfolio- typ	Name des Portfolios	Anlage- verwaltungsgebühr	Betriebskosten	Basiswährung
<b>Anleiheportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	0,50 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	0,60 %	0,13 %	EUR
<b>Aktienportfolios</b>				
	Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Global Select	0,75 %	0,11 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American	0,75 %	0,09 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Select	0,75 %	0,08 %	USD
	Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Asia Equities	0,75 %	0,16 %	USD
	Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	0,75 %	0,15 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	0,75 %	0,16 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	0,75 %	0,12 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Select	0,75 %	0,09 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	0,75 %	0,14 %	EUR
	Threadneedle (Lux) - UK Equities	0,75 %	0,08 %	GBP
	Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	0,75 %	0,09 %	GBP
<b>Extended-Alpha-Portfolio</b>				
	Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	0,75 %	0,15 %	USD

\*Siehe Erläuterung 1.

<sup>1</sup>1,75 % bis 30. November 2021.<sup>2</sup>0,30 % bis 30. November 2021.<sup>3</sup>2,25 % bis 30. November 2021.<sup>4</sup>0,75 % bis 31. August 2021.<sup>5</sup>0,20 % bis 31. August 2021.<sup>6</sup>0,20 % bis 30. November 2021.<sup>7</sup>0,25 % bis 31. August 2021.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 6 PROVISIONSTEILUNGSVEREINBARUNGEN

Die Verwaltungsgesellschaft und bestimmte Unterberater dürfen Provisionsteilungsvereinbarungen mit Makler-Händlern abschließen. Im Rahmen dieser Vereinbarungen stellen diese Makler-Händler direkt oder über Dritte bestimmte gewerbliche Dienstleistungen bereit, die sie aus den für die Aufträge der SICAV erhaltenen Provisionen bezahlen. Für die bestmögliche Ausführung können Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Unterberater an Makler-Händler insbesondere für von diesen erbrachte Forschungsleistungen sowie Dienstleistungen im Zusammenhang mit der Ausführung von Bestellungen gewährt werden. Zusätzliche Informationen zu den Praktiken der einzelnen Unterberater in Bezug auf Provisionsteilungsvereinbarungen finden Sie im Abschnitt „Anlageberatungsvereinbarungen“ des Verkaufsprospekts.

Alle von der Verwaltungsgesellschaft oder einem Unterberater eingegangenen Provisionsteilungsvereinbarungen unterliegen den folgenden Bedingungen: (i) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater handelt, wenn sie bzw. er Provisionsteilungsvereinbarungen eingeht, jederzeit im besten Interesse der SICAV und ihrer Anteilhaber; (ii) die erbrachten Dienstleistungen stehen in direktem Zusammenhang mit den Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft oder des Unterbauers; (iii) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater gewähren Maklerprovisionen für Portfoliotransaktionen der SICAV nur Makler-Händlern, bei denen es sich nicht um natürliche, sondern um juristische Personen handelt; (iv) Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen sind nicht ausschlaggebend für die Auswahl der Makler-Händler für die Abwicklung; (v) die Verwaltungsgesellschaft oder der Unterberater legen dem Verwaltungsrat einen Bericht über die Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen vor, aus welchem auch die Art der von ihnen erhaltenen Dienstleistungen hervorgeht; (vi) weder die Verwaltungsgesellschaft, der Unterberater noch eine mit ihnen verbundene Person darf von Makler-Händlern Bargeld oder sonstige Vergünstigungen erhalten; (vii) die erhaltenen Waren oder Dienstleistungen besitzen einen nachweisbaren Nutzen für die Anteilhaber; und (viii) es erfolgt eine regelmäßige Offenlegung im Jahresbericht der SICAV in Form einer Erklärung, in der die jeweiligen Vereinbarungen über die Aufteilung von Provisionen beschrieben sind, einschließlich einer Beschreibung der erhaltenen Waren und Dienstleistungen. Die erhaltenen Waren und Dienstleistungen können Folgendes beinhalten: Analysen, die für den Entscheidungsfindungsprozess des Unterbauers von zusätzlichem Nutzen sein können, und Abwicklungsdienste, die die Möglichkeiten des Unterbauers zur Durchführung von Transaktionen erweitern.

Nur die Unterberater Columbia Management Investment Advisors, LLC und STANLIB Asset Management (Pty) Limited dürfen Provisionsteilungsvereinbarungen abschließen.

### 7 DIVIDENDEN

Die SICAV hat im Berichtsjahr zum 31. März 2022 die folgenden Dividenden erklärt:

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,065	119.718
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,066	119.934
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,060	102.796
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,070	113.307
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,070	6.531
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,073	8.164
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,067	6.767
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,077	9.151
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,060	7.214
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,059	7.004
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,054	4.844
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,063	5.408
	Klasse DUP	24.06.2021	USD	0,068	3.960
	Klasse DUP	24.09.2021	USD	0,067	3.659
	Klasse DUP	22.12.2021	USD	0,059	3.479
	Klasse DUP	25.03.2022	USD	0,069	4.710
	Klasse IEC	24.06.2021	EUR	0,063	153.279
	Klasse IEC	24.09.2021	EUR	0,062	156.909
	Klasse IEC	22.12.2021	EUR	0,059	90.148
	Klasse IEC	25.03.2022	EUR	0,068	47.389
Klasse IEP	24.06.2021	EUR	0,065	8	
Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,065	6	
Klasse IEP	22.12.2021	EUR	0,063	5	
Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,074	6	
Klasse IGC	24.06.2021	GBP	0,062	18.371	
Klasse IGC	24.09.2021	GBP	0,065	16.923	
Klasse IGC	22.12.2021	GBP	0,060	85	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	Klasse IGC	25.03.2022	GBP	0,070	99
	Klasse IUP	24.06.2021	USD	0,067	14.801
	Klasse IUP	24.09.2021	USD	0,068	36.735
	Klasse IUP	22.12.2021	USD	0,062	33.495
	Klasse IUP	25.03.2022	USD	0,072	41.642
	Klasse NEC	24.06.2021	EUR	0,064	14.293
	Klasse NEC	24.09.2021	EUR	0,064	14.117
	Klasse NEC	22.12.2021	EUR	0,059	13.707
	Klasse NEC	25.03.2022	EUR	0,068	15.500
	Klasse NGC	24.06.2021	GBP	0,061	868.875
	Klasse NGC	24.09.2021	GBP	0,064	969.086
	Klasse NGC	22.12.2021	GBP	0,058	901.166
	Klasse NGC	25.03.2022	GBP	0,068	1.068.893
	Klasse NUP	24.06.2021	USD	0,067	5.904
	Klasse NUP	24.09.2021	USD	0,067	5.688
	Klasse NUP	22.12.2021	USD	0,063	5.651
	Klasse NUP	25.03.2022	USD	0,072	6.459
					<b>USD 5.025.886</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>	Klasse IEP	24.06.2021	EUR	0,028	3
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,037	3
	Klasse IEP	22.12.2021	EUR	0,033	3
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,036	3
					<b>EUR 12</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,368	2.032.159
	Klasse ZEP	25.03.2022	EUR	0,367	173.646
	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,365	465.536
	Klasse 1GP	25.03.2022	GBP	0,337	1.782
	Klasse 1UT	26.04.2021	USD	0,031	5.579
	Klasse 1UT	21.05.2021	USD	0,025	5.803
	Klasse 1UT	24.06.2021	USD	0,034	8.101
	Klasse 1UT	26.07.2021	USD	0,032	7.832
	Klasse 1UT	24.08.2021	USD	0,032	7.849
	Klasse 1UT	24.09.2021	USD	0,031	7.598
	Klasse 1UT	25.10.2021	USD	0,030	7.418
	Klasse 1UT	23.11.2021	USD	0,031	7.938
	Klasse 1UT	22.12.2021	USD	0,030	7.671
	Klasse 1UT	25.01.2022	USD	0,035	8.912
	Klasse 1UT	22.02.2022	USD	0,029	7.367
	Klasse 1UT	25.03.2022	USD	0,033	8.633
	Klasse 2EP	25.03.2022	EUR	0,365	31
	Klasse 2GP	25.03.2022	GBP	0,339	30
	Klasse 3EP	25.03.2022	EUR	0,372	854.656
	Klasse 3FC	25.03.2022	CHF	0,350	4.501
	Klasse 3GP	25.03.2022	GBP	0,341	45.078
	Klasse 8EP	25.03.2022	EUR	0,370	2.055.542
	Klasse 8GP	25.03.2022	GBP	0,359	2.159
Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,373	2.825	
Klasse 9FC	25.03.2022	CHF	0,348	31	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b> (Fortsetzung)	Klasse 9GP	25.03.2022	GBP	0,339	30
					<b>EUR 5.728.707</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	3,605	604
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	3,577	299.956
	Klasse IGC	25.03.2022	GBP	3,510	34
	Klasse XGC	25.03.2022	GBP	3,658	313.455
					<b>EUR 614.049</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>	Klasse AEP	24.06.2021	EUR	0,026	78
	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,026	1.170
	Klasse AEP	22.12.2021	EUR	0,026	1.170
	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,027	1.215
	Klasse ASC	24.06.2021	SGD	0,026	2
	Klasse ASC	24.09.2021	SGD	0,026	2
	Klasse ASC	22.12.2021	SGD	0,027	2
	Klasse ASC	25.03.2022	SGD	0,029	2
	Klasse AUC	24.06.2021	USD	0,028	2
	Klasse AUC	24.09.2021	USD	0,029	2
	Klasse AUC	22.12.2021	USD	0,027	2
	Klasse AUC	25.03.2022	USD	0,028	3
	Klasse IEP	24.06.2021	EUR	0,026	81.999
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,026	85.835
	Klasse IEP	22.12.2021	EUR	0,029	86.501
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,028	80.066
	Klasse ISC	24.06.2021	SGD	0,026	2
	Klasse ISC	24.09.2021	SGD	0,026	2
	Klasse ISC	22.12.2021	SGD	0,027	2
	Klasse ISC	25.03.2022	SGD	0,029	2
	Klasse IUC	24.06.2021	USD	0,028	2
	Klasse IUC	24.09.2021	USD	0,026	606
	Klasse IUC	22.12.2021	USD	0,026	1.223
	Klasse IUC	25.03.2022	USD	0,027	2.293
	Klasse NEP	24.06.2021	EUR	2,700	249.906
	Klasse NEP	24.09.2021	EUR	2,621	254.973
	Klasse NEP	22.12.2021	EUR	2,711	264.390
	Klasse NEP	25.03.2022	EUR	2,815	275.250
	Klasse ZEP	24.06.2021	EUR	0,027	8.546
	Klasse ZEP	24.09.2021	EUR	0,026	12.884
	Klasse ZEP	22.12.2021	EUR	0,027	17.130
	Klasse ZEP	25.03.2022	EUR	0,028	16.601
	Klasse ZGC	24.06.2021	GBP	0,027	54.969
	Klasse ZGC	24.09.2021	GBP	0,027	68.716
	Klasse ZGC	22.12.2021	GBP	0,028	93.601
	Klasse ZGC	25.03.2022	GBP	0,029	123.780
					<b>EUR 1.782.929</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	Klasse AEP	26.04.2021	EUR	0,032	23.679
	Klasse AEP	21.05.2021	EUR	0,032	23.157
	Klasse AEP	24.06.2021	EUR	0,032	23.231
	Klasse AEP	26.07.2021	EUR	0,032	23.267
	Klasse AEP	24.08.2021	EUR	0,032	23.784
	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,035	25.411
	Klasse AEP	25.10.2021	EUR	0,035	25.006
	Klasse AEP	23.11.2021	EUR	0,035	24.725
	Klasse AEP	22.12.2021	EUR	0,035	24.052
	Klasse AEP	25.01.2022	EUR	0,035	23.878
	Klasse AEP	22.02.2022	EUR	0,035	24.073
	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,033	22.541
	Klasse DEP	26.04.2021	EUR	0,024	39.117
	Klasse DEP	21.05.2021	EUR	0,024	40.122
	Klasse DEP	24.06.2021	EUR	0,024	41.969
	Klasse DEP	26.07.2021	EUR	0,024	42.803
	Klasse DEP	24.08.2021	EUR	0,024	43.383
	Klasse DEP	24.09.2021	EUR	0,026	47.210
	Klasse DEP	25.10.2021	EUR	0,026	46.995
	Klasse DEP	23.11.2021	EUR	0,026	44.732
	Klasse DEP	22.12.2021	EUR	0,026	44.566
	Klasse DEP	25.01.2022	EUR	0,026	43.625
	Klasse DEP	22.02.2022	EUR	0,026	42.813
	Klasse DEP	25.03.2022	EUR	0,025	40.031
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	Klasse AEC	26.04.2021	EUR	0,043	26.733
	Klasse AEC	21.05.2021	EUR	0,043	26.971
	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,043	26.363
	Klasse AEC	26.07.2021	EUR	0,043	25.371
	Klasse AEC	24.08.2021	EUR	0,043	24.921
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,043	24.821
	Klasse AEC	25.10.2021	EUR	0,043	24.884
	Klasse AEC	23.11.2021	EUR	0,043	23.605
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,042	22.394
	Klasse AEC	25.01.2022	EUR	0,042	19.919
	Klasse AEC	22.02.2022	EUR	0,042	18.929
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,037	15.885
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,028	22.712
	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,028	21.719
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,028	21.565
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,028	21.399
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,028	21.579
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,028	21.542
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,028	21.422
	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,028	21.212
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,027	20.336
	Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,027	20.142
	Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,027	20.074
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,024	17.570



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b> (Fortsetzung)	Klasse DEC	26.04.2021	EUR	0,032	2.117
	Klasse DEC	21.05.2021	EUR	0,032	2.130
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,031	1.965
	Klasse DEC	26.07.2021	EUR	0,031	1.942
	Klasse DEC	24.08.2021	EUR	0,031	1.942
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,031	1.845
	Klasse DEC	25.10.2021	EUR	0,031	1.664
	Klasse DEC	23.11.2021	EUR	0,031	1.594
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,030	1.476
	Klasse DEC	25.01.2022	EUR	0,030	1.430
	Klasse DEC	22.02.2022	EUR	0,030	1.526
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,027	1.302
	Klasse IEC	26.04.2021	EUR	0,033	4
	Klasse IEC	21.05.2021	EUR	0,033	12.297
	Klasse IEC	24.06.2021	EUR	0,033	11.980
	Klasse IEC	26.07.2021	EUR	0,033	11.842
	Klasse IEC	24.08.2021	EUR	0,033	11.820
	Klasse IEC	24.09.2021	EUR	0,033	11.829
	Klasse IEC	25.10.2021	EUR	0,033	19.182
	Klasse IEC	23.11.2021	EUR	0,033	18.523
	Klasse IEC	22.12.2021	EUR	0,032	6.995
	Klasse IEC	25.01.2022	EUR	0,032	7.024
	Klasse IEC	22.02.2022	EUR	0,032	7.044
	Klasse IEC	25.03.2022	EUR	0,029	6.196
	Klasse XUP	24.06.2021	USD	0,112	11
	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,129	11
	Klasse XUP	22.12.2021	USD	0,121	10
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,133	11
					<b>USD 677.780</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>	Klasse AEC	26.04.2021	EUR	0,035	3.126
	Klasse AEC	21.05.2021	EUR	0,035	3.170
	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,036	3.140
	Klasse AEC	26.07.2021	EUR	0,036	3.042
	Klasse AEC	24.08.2021	EUR	0,036	2.974
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,037	3.057
	Klasse AEC	25.10.2021	EUR	0,037	3.007
	Klasse AEC	23.11.2021	EUR	0,037	2.873
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,036	2.551
	Klasse AEC	25.01.2022	EUR	0,036	2.484
	Klasse AEC	22.02.2022	EUR	0,036	2.454
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,032	1.821
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,043	134.552
	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,043	133.785
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,044	136.088
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,044	134.286
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,044	132.261
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,046	136.512
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,046	134.882

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b> (Fortsetzung)	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,046	133.873
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,044	126.356
	Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,044	125.388
	Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,044	124.439
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,039	108.705
	Klasse SUP	26.04.2021	USD	0,041	2.108
	Klasse SUP	21.05.2021	USD	0,041	2.108
	Klasse SUP	24.06.2021	USD	0,042	2.160
	Klasse SUP	26.07.2021	USD	0,042	2.155
	Klasse SUP	24.08.2021	USD	0,042	2.128
	Klasse SUP	24.09.2021	USD	0,044	2.226
	Klasse SUP	25.10.2021	USD	0,044	2.193
	Klasse SUP	23.11.2021	USD	0,044	2.162
	Klasse SUP	22.12.2021	USD	0,042	2.052
	Klasse SUP	25.01.2022	USD	0,042	2.052
	Klasse SUP	22.02.2022	USD	0,042	2.052
	Klasse SUP	25.03.2022	USD	0,038	1.848
	Klasse XUP	24.06.2021	USD	0,122	12
	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,134	12
	Klasse XUP	22.12.2021	USD	0,122	11
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,122	11
					<b>USD 1.620.116</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>	Klasse AEC	26.04.2021	EUR	0,021	89.183
	Klasse AEC	21.05.2021	EUR	0,021	66.070
	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,021	64.297
	Klasse AEC	26.07.2021	EUR	0,021	63.572
	Klasse AEC	24.08.2021	EUR	0,021	63.480
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,021	63.189
	Klasse AEC	25.10.2021	EUR	0,021	62.328
	Klasse AEC	23.11.2021	EUR	0,021	59.582
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,021	59.257
	Klasse AEC	25.01.2022	EUR	0,021	59.223
	Klasse AEC	22.02.2022	EUR	0,021	59.279
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,018	49.287
	Klasse ASC	26.04.2021	SGD	0,029	3.075
	Klasse ASC	21.05.2021	SGD	0,029	3.044
	Klasse ASC	24.06.2021	SGD	0,029	2.966
	Klasse ASC	26.07.2021	SGD	0,029	2.939
	Klasse ASC	24.08.2021	SGD	0,029	2.994
	Klasse ASC	24.09.2021	SGD	0,028	2.916
	Klasse ASC	25.10.2021	SGD	0,028	2.926
	Klasse ASC	23.11.2021	SGD	0,028	2.897
	Klasse ASC	22.12.2021	SGD	0,029	2.994
	Klasse ASC	25.01.2022	SGD	0,029	3.020
	Klasse ASC	22.02.2022	SGD	0,029	3.029
	Klasse ASC	25.03.2022	SGD	0,025	847
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,023	38.087

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b> (Fortsetzung)	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,023	37.686
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,022	35.938
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,022	35.557
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,022	35.300
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,022	34.683
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,022	34.403
	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,022	33.603
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,023	34.956
	Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,023	34.758
	Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,023	34.159
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,019	27.914
	Klasse XUP	26.04.2021	USD	0,039	35.263
	Klasse XUP	21.05.2021	USD	0,039	35.263
	Klasse XUP	24.06.2021	USD	0,039	35.263
	Klasse XUP	26.07.2021	USD	0,039	35.263
	Klasse XUP	24.08.2021	USD	0,039	35.263
	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,039	34.036
	Klasse XUP	25.10.2021	USD	0,039	28.767
	Klasse XUP	23.11.2021	USD	0,039	20.883
	Klasse XUP	22.12.2021	USD	0,039	19.853
	Klasse XUP	25.01.2022	USD	0,039	14.197
	Klasse XUP	22.02.2022	USD	0,039	14.197
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,034	12.379
					<b>USD 1.530.065</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>	Klasse AEC	26.04.2021	EUR	0,055	1.948
	Klasse AEC	21.05.2021	EUR	0,055	1.975
	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,055	1.924
	Klasse AEC	26.07.2021	EUR	0,055	1.902
	Klasse AEC	24.08.2021	EUR	0,055	1.903
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,055	1.904
	Klasse AEC	25.10.2021	EUR	0,055	1.888
	Klasse AEC	23.11.2021	EUR	0,055	1.632
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,051	1.510
	Klasse AEC	25.01.2022	EUR	0,051	1.427
	Klasse AEC	22.02.2022	EUR	0,051	1.250
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,048	1.210
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,059	17.179
	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,059	17.188
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,059	17.159
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,059	17.476
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,059	15.495
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,059	15.517
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,059	15.323
	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,059	15.166
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,055	14.104
	Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,055	14.057
	Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,055	13.842

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b> (Fortsetzung)	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,052	12.917
	Klasse DEC	26.04.2021	EUR	0,041	1.483
	Klasse DEC	21.05.2021	EUR	0,041	1.464
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,042	1.461
	Klasse DEC	26.07.2021	EUR	0,042	1.444
	Klasse DEC	24.08.2021	EUR	0,042	1.446
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,042	1.473
	Klasse DEC	25.10.2021	EUR	0,042	1.443
	Klasse DEC	23.11.2021	EUR	0,042	1.364
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,039	1.269
	Klasse DEC	25.01.2022	EUR	0,039	1.274
	Klasse DEC	22.02.2022	EUR	0,039	1.278
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,036	989
	Klasse IEC	26.04.2021	EUR	0,040	5
	Klasse IEC	21.05.2021	EUR	0,040	5
	Klasse IEC	24.06.2021	EUR	0,040	5
	Klasse IEC	26.07.2021	EUR	0,040	5
	Klasse IEC	24.08.2021	EUR	0,040	4
	Klasse IEC	24.09.2021	EUR	0,041	4
	Klasse IEC	25.10.2021	EUR	0,041	4
	Klasse IEC	23.11.2021	EUR	0,041	4
	Klasse IEC	22.12.2021	EUR	0,038	4
	Klasse IEC	25.01.2022	EUR	0,038	4
	Klasse IEC	22.02.2022	EUR	0,038	4
	Klasse IEC	25.03.2022	EUR	0,036	4
	Klasse ISC	24.08.2021	SGD	0,044	4
	Klasse ISC	24.09.2021	SGD	0,044	4
	Klasse ISC	25.10.2021	SGD	0,044	4
	Klasse ISC	23.11.2021	SGD	0,044	37
	Klasse ISC	22.12.2021	SGD	0,041	126
	Klasse ISC	25.01.2022	SGD	0,041	2.698
	Klasse ISC	22.02.2022	SGD	0,041	3.804
	Klasse ISC	25.03.2022	SGD	0,039	4.288
	Klasse XUP	24.06.2021	USD	0,139	14
	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,149	13
	Klasse XUP	22.12.2021	USD	0,137	12
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,141	13
					<b>USD 233.353</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>	Klasse ASC	26.04.2021	SGD	0,032	323
	Klasse ASC	21.05.2021	SGD	0,032	339
	Klasse ASC	24.06.2021	SGD	0,032	335
	Klasse ASC	26.07.2021	SGD	0,032	342
	Klasse ASC	24.08.2021	SGD	0,032	263
	Klasse ASC	24.09.2021	SGD	0,034	79
	Klasse ASC	25.10.2021	SGD	0,034	88
	Klasse ASC	23.11.2021	SGD	0,034	92
	Klasse ASC	22.12.2021	SGD	0,034	99
	Klasse ASC	25.01.2022	SGD	0,034	101

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b> (Fortsetzung)	Klasse ASC	22.02.2022	SGD	0,034	101
	Klasse ASC	25.03.2022	SGD	0,031	95
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,033	40.709
	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,033	39.558
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,033	39.674
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,033	35.614
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,033	32.918
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,036	31.886
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,036	31.985
	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,036	28.945
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,035	27.578
	Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,035	24.623
	Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,035	24.772
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,032	22.722
	Klasse AVC	26.04.2021	AUD	0,031	2
	Klasse AVC	21.05.2021	AUD	0,031	2
	Klasse AVC	24.06.2021	AUD	0,031	2
	Klasse AVC	26.07.2021	AUD	0,031	2
	Klasse AVC	24.08.2021	AUD	0,031	2
	Klasse AVC	24.09.2021	AUD	0,033	2
	Klasse AVC	25.10.2021	AUD	0,033	2
	Klasse AVC	23.11.2021	AUD	0,033	2
	Klasse AVC	22.12.2021	AUD	0,032	2
	Klasse AVC	25.01.2022	AUD	0,032	2
	Klasse AVC	22.02.2022	AUD	0,032	2
	Klasse AVC	25.03.2022	AUD	0,029	2
	Klasse ZUP	26.04.2021	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	21.05.2021	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	24.06.2021	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	26.07.2021	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	24.08.2021	USD	0,032	3
	Klasse ZUP	24.09.2021	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	25.10.2021	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	23.11.2021	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	22.12.2021	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	25.01.2022	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	22.02.2022	USD	0,034	3
	Klasse ZUP	25.03.2022	USD	0,031	3
					<b>USD 383.301</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,002	0*
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,002	0*
	Klasse LEP	24.09.2021	EUR	0,002	0*
	Klasse ZEP	24.09.2021	EUR	0,002	1
					<b>EUR 1</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>	Klasse AEC	26.04.2021	EUR	0,012	923
	Klasse AEC	21.05.2021	EUR	0,012	933
	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,018	1.363
	Klasse AEC	26.07.2021	EUR	0,018	1.348
	Klasse AEC	24.08.2021	EUR	0,018	1.347
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,015	1.123
	Klasse AEC	25.10.2021	EUR	0,015	1.088
	Klasse AEC	23.11.2021	EUR	0,015	1.041
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,012	836
	Klasse AEC	25.01.2022	EUR	0,012	854
	Klasse AEC	22.02.2022	EUR	0,012	857
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,011	758
	Klasse AUP	26.04.2021	USD	0,014	5.272
	Klasse AUP	21.05.2021	USD	0,014	5.213
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,021	7.764
	Klasse AUP	26.07.2021	USD	0,021	7.629
	Klasse AUP	24.08.2021	USD	0,021	7.605
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,018	6.417
	Klasse AUP	25.10.2021	USD	0,018	6.393
	Klasse AUP	23.11.2021	USD	0,018	6.037
Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,013	4.308	
Klasse AUP	25.01.2022	USD	0,013	4.286	
Klasse AUP	22.02.2022	USD	0,013	4.272	
Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,013	4.222	
					<b>USD 81.889</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,104	663.930
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,104	636.548
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,102	563.058
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,078	391.816
	Klasse AEP	24.06.2021	EUR	0,117	237.007
	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,118	230.570
	Klasse AEP	22.12.2021	EUR	0,122	234.885
	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,096	193.344
	Klasse ASC	24.06.2021	SGD	0,122	1.593
	Klasse ASC	24.09.2021	SGD	0,121	2.512
	Klasse ASC	22.12.2021	SGD	0,120	1.618
	Klasse ASC	25.03.2022	SGD	0,092	1.277
	Klasse ASP	24.06.2021	SGD	0,121	523
	Klasse ASP	24.09.2021	SGD	0,121	540
	Klasse ASP	22.12.2021	SGD	0,121	517
	Klasse ASP	25.03.2022	SGD	0,092	374
	Klasse AUM	26.04.2021	USD	0,042	1.712
	Klasse AUM	21.05.2021	USD	0,042	1.712
	Klasse AUM	24.06.2021	USD	0,043	1.752
	Klasse AUM	26.07.2021	USD	0,043	1.752
Klasse AUM	24.08.2021	USD	0,043	1.752	
Klasse AUM	24.09.2021	USD	0,043	1.752	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b> (Fortsetzung)	Klasse AUM	25.10.2021	USD	0,043	1.752
	Klasse AUM	23.11.2021	USD	0,043	1.752
	Klasse AUM	22.12.2021	USD	0,042	1.715
	Klasse AUM	25.01.2022	USD	0,042	1.718
	Klasse AUM	22.02.2022	USD	0,042	1.715
	Klasse AUM	25.03.2022	USD	0,032	1.307
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,123	138.327
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,122	133.724
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,121	132.706
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,093	98.559
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,099	355.070
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,098	337.554
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,097	305.578
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,074	216.545
	Klasse DEP	24.06.2021	EUR	0,111	47.720
	Klasse DEP	24.09.2021	EUR	0,111	45.133
	Klasse DEP	22.12.2021	EUR	0,115	43.117
	Klasse DEP	25.03.2022	EUR	0,090	28.431
	Klasse DUP	24.06.2021	USD	0,112	235.562
	Klasse DUP	24.09.2021	USD	0,111	230.314
	Klasse DUP	22.12.2021	USD	0,110	227.161
	Klasse DUP	25.03.2022	USD	0,084	170.710
	Klasse ZEC	24.06.2021	EUR	0,115	14
	Klasse ZEC	24.09.2021	EUR	0,114	12
	Klasse ZEC	22.12.2021	EUR	0,113	12
	Klasse ZEC	25.03.2022	EUR	0,087	9
	Klasse ZUP	24.06.2021	USD	0,123	12
Klasse ZUP	24.09.2021	USD	0,123	12	
Klasse ZUP	22.12.2021	USD	0,122	12	
Klasse ZUP	25.03.2022	USD	0,093	9	
					<b>USD 5.926.806</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,064	8
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,043	5
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,064	6
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,043	4
	Klasse ZEC	24.09.2021	EUR	0,064	8
	Klasse ZEC	25.03.2022	EUR	0,043	5
	Klasse ZUP	24.09.2021	USD	0,064	6
	Klasse ZUP	25.03.2022	USD	0,043	4
					<b>USD 46</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,083	216.877
	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,071	233.779
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,067	2.258
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,054	2.126

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b> (Fortsetzung)	Klasse IUP	24.09.2021	USD	0,069	3.451
	Klasse IUP	25.03.2022	USD	0,056	2.816
	Klasse ZEP	24.09.2021	EUR	0,080	246.548
	Klasse ZEP	25.03.2022	EUR	0,074	269.403
					<b>USD 977.258</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,110	635
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,064	363
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,059	321
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,070	372
	Klasse AUP	24.06.2021	USD	0,117	12
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,070	6
	Klasse AUP	22.12.2021	USD	0,062	5
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,073	6
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,110	13
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,063	6
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,058	5
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,069	6
	Klasse DUP	24.06.2021	USD	0,115	12
	Klasse DUP	24.09.2021	USD	0,069	6
	Klasse DUP	22.12.2021	USD	0,061	5
	Klasse DUP	25.03.2022	USD	0,072	3.550
	Klasse 1EP	24.06.2021	EUR	0,115	210.331
	Klasse 1EP	24.09.2021	EUR	0,067	120.189
	Klasse 1EP	22.12.2021	EUR	0,064	105.944
	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,077	123.719
	Klasse 1SC	24.06.2021	SGD	0,119	40.317
	Klasse 1SC	24.09.2021	SGD	0,068	22.717
	Klasse 1SC	22.12.2021	SGD	0,061	20.139
	Klasse 1SC	25.03.2022	SGD	0,073	24.070
	Klasse 1ST	26.04.2021	SGD	0,040	2.503
	Klasse 1ST	21.05.2021	SGD	0,044	2.788
	Klasse 1ST	24.06.2021	SGD	0,030	1.892
	Klasse 1ST	26.07.2021	SGD	0,013	665
	Klasse 1ST	24.08.2021	SGD	0,036	1.821
	Klasse 1ST	24.09.2021	SGD	0,026	1.059
	Klasse 1ST	25.10.2021	SGD	0,020	821
	Klasse 1ST	23.11.2021	SGD	0,017	697
	Klasse 1ST	22.12.2021	SGD	0,023	947
	Klasse 1ST	25.01.2022	SGD	0,013	553
Klasse 1ST	22.02.2022	SGD	0,016	681	
Klasse 1ST	25.03.2022	SGD	0,043	1.806	
Klasse 1UP	24.06.2021	USD	0,118	51.262	
Klasse 1UP	24.09.2021	USD	0,069	29.575	
Klasse 1UP	22.12.2021	USD	0,062	25.810	
Klasse 1UP	25.03.2022	USD	0,074	30.700	
Klasse 1VT	26.04.2021	AUD	0,039	223	
Klasse 1VT	21.05.2021	AUD	0,043	247	
Klasse 1VT	24.06.2021	AUD	0,030	167	



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilkategorie	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilkategorie)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b> (Fortsetzung)	Klasse 1VT	26.07.2021	AUD	0,010	54
	Klasse 1VT	24.08.2021	AUD	0,035	189
	Klasse 1VT	24.09.2021	AUD	0,021	115
	Klasse 1VT	25.10.2021	AUD	0,019	107
	Klasse 1VT	23.11.2021	AUD	0,017	98
	Klasse 1VT	22.12.2021	AUD	0,022	125
	Klasse 1VT	25.01.2022	AUD	0,012	69
	Klasse 1VT	22.02.2022	AUD	0,016	94
	Klasse 1VT	25.03.2022	AUD	0,041	253
	Klasse 2EP	24.06.2021	EUR	0,115	14
	Klasse 2EP	24.09.2021	EUR	0,068	6
	Klasse 2EP	22.12.2021	EUR	0,065	5
	Klasse 2EP	25.03.2022	EUR	0,078	6
	Klasse 2UP	24.06.2021	USD	0,119	12
	Klasse 2UP	24.09.2021	USD	0,072	6
	Klasse 2UP	22.12.2021	USD	0,064	5
	Klasse 2UP	25.03.2022	USD	0,075	6
	Klasse 3EP	24.06.2021	EUR	0,114	1.349.752
	Klasse 3EP	24.09.2021	EUR	0,069	806.124
	Klasse 3EP	22.12.2021	EUR	0,065	601.000
	Klasse 3EP	25.03.2022	EUR	0,079	716.946
	Klasse 3UP	24.06.2021	USD	0,119	4.680
	Klasse 3UP	24.09.2021	USD	0,070	2.759
	Klasse 3UP	22.12.2021	USD	0,064	2.523
	Klasse 3UP	25.03.2022	USD	0,076	2.996
	Klasse 8EP	24.06.2021	EUR	0,114	23
	Klasse 8EP	24.09.2021	EUR	0,068	19
	Klasse 8EP	22.12.2021	EUR	0,064	17
	Klasse 8EP	25.03.2022	EUR	0,078	20
	Klasse 8UP	24.06.2021	USD	0,119	6.890
	Klasse 8UP	24.09.2021	USD	0,070	4.059
	Klasse 8UP	22.12.2021	USD	0,063	3.653
	Klasse 8UP	25.03.2022	USD	0,075	4.349
	Klasse 9EP	24.06.2021	EUR	0,115	14
	Klasse 9EP	24.09.2021	EUR	0,068	6
	Klasse 9EP	22.12.2021	EUR	0,065	5
	Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,079	6
	Klasse 9UP	24.06.2021	USD	0,119	12
	Klasse 9UP	24.09.2021	USD	0,072	6
	Klasse 9UP	22.12.2021	USD	0,064	5
	Klasse 9UP	25.03.2022	USD	0,076	6
					<b>USD 4.334.000</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,114	2.157.448
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,106	7.057
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,096	230.480
					<b>EUR 2.394.985</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - American	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,194	66.138
					<b>USD 66.138</b>
Threadneedle (Lux) - American Select	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,066	28.362
					<b>USD 28.362</b>
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,213	238.798
					<b>USD 238.798</b>
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,230	885.956
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,119	331.803
					<b>USD 1.217.759</b>
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,116	46
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,131	49
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,125	1.353
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,150	1.423
				<b>USD 2.871</b>	
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,138	47
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,157	10
	Klasse IEC	24.09.2021	EUR	0,129	9
	Klasse IEC	25.03.2022	EUR	0,149	10
				<b>USD 76</b>	
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,336	22
	Klasse 1GP	25.03.2022	GBP	0,311	22
	Klasse 3GP	25.03.2022	GBP	0,319	143
	Klasse 9GP	25.03.2022	GBP	0,320	22
				<b>EUR 209</b>	
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	Klasse 1EP	24.09.2021	EUR	0,030	321.819
	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,014	152.433
	Klasse 1GP	24.09.2021	GBP	0,025	9.937
	Klasse 1GP	25.03.2022	GBP	0,012	5.065
	Klasse 2EP	24.09.2021	EUR	0,298	21
	Klasse 2EP	25.03.2022	EUR	0,149	11
	Klasse 2GP	24.09.2021	GBP	0,290	21
	Klasse 2GP	25.03.2022	GBP	0,141	11
	Klasse 3EP	24.09.2021	EUR	0,047	3.349
	Klasse 3EP	25.03.2022	EUR	0,024	1.710
	Klasse 3GP	24.09.2021	GBP	0,040	35.200
	Klasse 3GP	25.03.2022	GBP	0,020	16.300
	Klasse 4GP	24.09.2021	GBP	0,037	279.782
	Klasse 4GP	25.03.2022	GBP	0,017	112.390
Klasse 8EP	24.09.2021	EUR	0,031	29.686	
Klasse 8EP	25.03.2022	EUR	0,016	13.772	
Klasse 8GP	24.09.2021	GBP	0,027	13.993	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b> (Fortsetzung)	Klasse 8GP	25.03.2022	GBP	0,013	7.054
	Klasse 9EP	24.09.2021	EUR	0,319	2.670
	Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,150	11
	Klasse 9GP	24.09.2021	GBP	0,290	21
	Klasse 9GP	25.03.2022	GBP	0,142	11
	Klasse AEP	24.09.2021	EUR	0,292	3.134
	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,146	2.227
	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,312	21
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,145	11
	Klasse DEP	24.09.2021	EUR	0,289	755
	Klasse DEP	25.03.2022	EUR	0,144	424
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,299	188.003
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,150	127.782
	Klasse ZEP	24.09.2021	EUR	0,298	4.670
	Klasse ZEP	25.03.2022	EUR	0,149	3.398
					<b>EUR 1.335.692</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,164	173.604
	Klasse 3EP	25.03.2022	EUR	0,167	202.796
	Klasse 3GP	25.03.2022	GBP	0,155	40.726
	Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,168	11
	Klasse 9GP	25.03.2022	GBP	0,156	11
					<b>EUR 417.148</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,194	169.490
	Klasse 2EP	25.03.2022	EUR	0,197	15.598
	Klasse 8EP	25.03.2022	EUR	0,197	6.554
					<b>EUR 191.642</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,185	607.913
	Klasse 3EP	25.03.2022	EUR	0,188	147.653
	Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,180	112.699
					<b>EUR 868.265</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>	Klasse AUP	24.09.2021	USD	0,323	6.766
	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,183	26.701
	Klasse DUP	24.09.2021	USD	0,317	6.709
	Klasse DUP	25.03.2022	USD	0,178	7.318
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,316	197.969
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,192	174.615
	Klasse XUP	24.09.2021	USD	0,335	170.243
	Klasse XUP	25.03.2022	USD	0,191	54.029
	Klasse ZGP	24.09.2021	GBP	0,279	21
	Klasse ZGP	25.03.2022	GBP	0,165	12
	Klasse ZUP	24.09.2021	USD	0,371	1.316
	Klasse ZUP	25.03.2022	USD	0,212	769
					<b>USD 646.468</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilklasse	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>	Klasse AUP	25.03.2022	USD	0,163	11.791
					<b>USD 11.791</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>	Klasse AGP	24.09.2021	GBP	0,375	29.513
	Klasse AGP	25.03.2022	GBP	0,251	18.121
	Klasse IGP	24.09.2021	GBP	0,551	1.289.225
	Klasse IGP	25.03.2022	GBP	0,370	262.521
	Klasse NGP	24.09.2021	GBP	0,225	13
	Klasse NGP	25.03.2022	GBP	0,148	8
	Klasse TGP	24.09.2021	GBP	0,225	13
	Klasse TGP	25.03.2022	GBP	0,148	8
	Klasse ZGP	24.09.2021	GBP	0,202	254.950
	Klasse ZGP	25.03.2022	GBP	0,132	170.000
	Klasse 9EP	24.09.2021	EUR	0,184	745.194
	Klasse 9EP	25.03.2022	EUR	0,124	268.125
					<b>GBP 3.037.691</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>	Klasse AEC	24.06.2021	EUR	0,115	6.432
	Klasse AEC	24.09.2021	EUR	0,070	3.928
	Klasse AEC	22.12.2021	EUR	0,077	4.327
	Klasse AEC	25.03.2022	EUR	0,054	3.463
	Klasse ASC	24.06.2021	SGD	0,119	11
	Klasse ASC	24.09.2021	SGD	0,073	5
	Klasse ASC	22.12.2021	SGD	0,080	6
	Klasse ASC	25.03.2022	SGD	0,055	4
	Klasse AUC	24.06.2021	USD	0,124	49.715
	Klasse AUC	24.09.2021	USD	0,074	30.408
	Klasse AUC	22.12.2021	USD	0,083	41.190
	Klasse AUC	25.03.2022	USD	0,058	26.222
	Klasse DEC	24.06.2021	EUR	0,111	11
	Klasse DEC	24.09.2021	EUR	0,068	5
	Klasse DEC	22.12.2021	EUR	0,074	6
	Klasse DEC	25.03.2022	EUR	0,052	553
	Klasse DGP	24.06.2021	GBP	0,120	12
	Klasse DGP	24.09.2021	GBP	0,074	5
	Klasse DGP	22.12.2021	GBP	0,081	6
	Klasse DGP	25.03.2022	GBP	0,056	22
	Klasse IGP	24.06.2021	GBP	0,124	155.152
	Klasse IGP	24.09.2021	GBP	0,073	94.594
	Klasse IGP	22.12.2021	GBP	0,084	113.310
	Klasse IGP	25.03.2022	GBP	0,058	74.419
	Klasse LGP	24.06.2021	GBP	0,125	1.131.701
	Klasse LGP	24.09.2021	GBP	0,075	784.215
	Klasse LGP	22.12.2021	GBP	0,085	875.654
Klasse LGP	25.03.2022	GBP	0,060	627.573	
Klasse ZGP	24.06.2021	GBP	0,129	831	
Klasse ZGP	24.09.2021	GBP	0,080	1.392	
Klasse ZGP	22.12.2021	GBP	0,088	10.748	
Klasse ZGP	25.03.2022	GBP	0,061	7.718	
				<b>GBP 4.043.638</b>	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 7 DIVIDENDEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Anteilkategorie	Ex-Datum	Währung der Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Währung der Anteilklasse)	Gesamtbetrag (in der Währung des Portfolios)
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>	Klasse 1EP	25.03.2022	EUR	0,304	18.132
	Klasse 2EP	25.03.2022	EUR	0,306	17.916
	Klasse 2GC	25.03.2022	GBP	0,304	28
	Klasse 8EP	25.03.2022	EUR	0,310	37.670
	Klasse 8GC	25.03.2022	GBP	0,311	13.802
					<b>EUR 87.548</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>	Klasse IEP	24.06.2021	EUR	0,057	6
	Klasse IEP	24.09.2021	EUR	0,061	5
	Klasse IEP	22.12.2021	EUR	0,057	5
	Klasse IEP	25.03.2022	EUR	0,065	6
	Klasse LEP	24.06.2021	EUR	0,057	6
	Klasse LEP	24.09.2021	EUR	0,061	5
	Klasse LEP	22.12.2021	EUR	0,058	5
	Klasse LEP	25.03.2022	EUR	0,067	6
					<b>EUR 44</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>	Klasse AEP	25.03.2022	EUR	0,043	1.219
					<b>EUR 1.219</b>

\*Bruchteilsbetrag auf 0 gerundet.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 8 PERFORMANCEGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft erhält in Bezug auf die Anteilsklassen der in der nachstehenden Tabelle aufgeführten Portfolios eine Performancegebühr. Für die Performancegebühr werden tägliche Rückstellungen im Hinblick auf den Saldo der Performancegebühr gebildet (wie nachstehend beschrieben), wobei der aufgelaufene Betrag am Ende jedes Kalenderjahres (d. h. am 31. Dezember) an die Verwaltungsgesellschaft ausbezahlt wird. Die Verwaltungsgesellschaft ist für die Zahlung der gesamten oder eines Teils der Performancegebühr an die Unterberater gemäß deren Unterberatungsvertrag verantwortlich. Die Höhe dieser Performancegebühr hängt von der Wertentwicklung des Nettoinventarwertes (NIW) der betreffenden Anteilsklasse innerhalb des betreffenden Portfolios im Vergleich zu der Wertentwicklung des jeweiligen Performance-Index ab (der „Performance-Index“, wie in der nachstehenden Tabelle aufgeführt). Es laufen nur dann Gebühren auf, wenn der Saldo der Performancegebühr positiv ist und die NIW High Water Mark (wie nachstehend definiert) überschritten wird.

Die Wertentwicklung der Anteilsklassen wird unter Berücksichtigung gezahlter Ausschüttungen ermittelt.

Portfolio	Anteilsklassen	Performance-Index	Performance-Satz
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert aus der 90-tägigen Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) <sup>1</sup> zzgl. 1,75 % oder 1,50 %	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	Z-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	J-Anteile	Der höhere Wert aus dem kumulierten €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat <sup>2</sup> zzgl. 1,00 % oder 1,00 %	10 %
	Y-Anteile		
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	A-Anteile	Der höhere Wert aus dem 3-monatigen Euro Interbank Offered Rate (EURIBOR) <sup>3</sup> zzgl. 1,50 % oder 1,50 %	20 %
	D-Anteile		
	I-Anteile		
	L-Anteile		
	Z-Anteile		

<sup>1</sup> Ab 1. September 2021. Bis einschließlich 31. August 2021 ist der Performance-Index der höhere Wert aus dem 3-monatigen USD LIBOR zzgl. 1,50 % oder 1,50 %. Die Benchmark wird von The Federal Reserve Bank of New York bereitgestellt. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden.

<sup>2</sup> Ab 1. September 2021. Bis einschließlich 31. August 2021 ist der Performance-Index der höhere Wert aus dem ICE BofA Euro Currency 1-Month Deposit Bid Rate Constant Maturity Index (Local Total Return) zzgl. 1,00 % oder 1,00 %. Die Benchmark wird von der Europäischen Zentralbank (EZB) bereitgestellt. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden.

<sup>3</sup> Die Benchmark wird von ICE Benchmark Administration Limited bereitgestellt, einem Administrator, der im ESMA-Register der Benchmark-Administratoren eingetragen ist. Die Verwaltungsgesellschaft unterhält einen schriftlichen Plan, in dem die Maßnahmen festgelegt sind, die im Falle einer wesentlichen Änderung oder Einstellung der Benchmark ergriffen werden.

Die Wertentwicklung des Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha Portfolio, des Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities Portfolio und des Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha Portfolio, einschließlich der Auswirkungen aller maßgeblichen Gebühren, wird mit dem Performance-Index verglichen.

NIW High Water Mark: Bezüglich der einzelnen Anteilsklassen entspricht der Nettoinventarwert eines Anteils dieser Anteilsklasse dem des letzten Bewertungsstichtags des letzten relevanten Kalenderjahres, in dem eine eventuell aufgelaufene Performancegebühr bezahlt wurde. Wurde noch nie eine Performancegebühr gezahlt, entspricht die NIW High Water Mark dem Anfangspreis der jeweiligen Anteilsklasse.

Der Saldo der Performancegebühr wird basierend auf der Differenz zwischen der Wertentwicklung des Performance-Index und der Wertentwicklung der betreffenden Anteilsklasse berechnet (die „Tagesdifferenz“):

- (i) Wenn die Tagesdifferenz positiv ist, steigt der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird;
- (ii) Ist die Tagesdifferenz negativ, verringert sich der Saldo der Performancegebühr um einen Betrag, der sich nach der Tagesdifferenz richtet und anhand des Performance-Gebührensatzes bestimmt wird.

Ist der Saldo der Performancegebühr am Ende des Kalenderjahres, d. h. am 31. Dezember, positiv und wurde die NIW High Water Mark überschritten, so wird der aufgelaufene Betrag der Performancegebühr innerhalb des ersten Quartals des folgenden Kalenderjahres an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt. Eine Performancegebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft nur in dem Fall gezahlt, in dem der Nettoinventarwert der betreffenden Anteilsklasse über der NIW High Water Mark liegt und der Saldo der Performancegebühr positiv ist.

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performancegebühr negativ ist und die NIW High Water Mark nicht überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Performancegebühr, bis die aufgelaufene Performancegebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und die NIW High Water Mark überschritten wurde.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 8 PERFORMANCEGEBÜHREN

(Fortsetzung)

Wenn am Ende des Kalenderjahres der Saldo der Performancegebühr negativ ist und die NIW High Water Mark überschritten wurde, wird dieser negative Betrag vorgetragen und die Verwaltungsgesellschaft erhält so lange keine Performancegebühr, bis der Saldo der aufgelaufenen Performancegebühr am Ende eines nachfolgenden Kalenderjahres wieder positiv ausfällt und die NIW High Water Mark überschritten wurde.

Falls ein Portfolio oder eine Anteilklasse liquidiert oder ein Portfolio oder eine Anteilklasse inaktiv werden, werden noch ausstehende, aufgelaufene Performancegebühren abgerechnet und an die Verwaltungsgesellschaft zahlbar. Investieren im Anschluss daran neue Anteilhaber in ein solches Portfolio oder eine solche Anteilklasse, wird der Saldo der Performancegebühr zurückgesetzt.

Die Performancegebühr ist nicht begrenzt.

Zum 31. März 2022 wurden die folgenden Performancegebühren gezahlt:

Portfolio	Anteilklasse	Betrag je Anteil (in der Portfolio-Basiswährung)
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>	Klasse IU	2.846
	Klasse IGH	7.563
	Klasse ZGH	12
	Klasse ZU	3
		<b>USD 10.424</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>	Klasse AE	128.717
	Klasse AEP	559
	Klasse AUH	217
	Klasse DE	63.450
	Klasse IE	226.346
	Klasse IGH	7.391
	Klasse LE	204.557
	Klasse ZE	19.008
	Klasse ZFH	617
	Klasse ZGH	8
		<b>EUR 650.870</b>

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

Zum 31. März 2022 hielt die SICAV die folgenden offenen Devisenterminkontrakte:

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b>	19.04.2022	EUR	10.976.067	USD	12.087.778	Absicherung	JP Morgan Chase New York	131.526
	19.04.2022	EUR	14.614.761	USD	16.095.017	Absicherung	JP Morgan Chase New York	175.129
	19.04.2022	SEK	7.888	USD	824	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2022	EUR	2.105.563	USD	2.318.825	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25.231
	19.04.2022	EUR	700.171	USD	771.088	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.390
	19.04.2022	EUR	13.428.359	USD	14.788.450	Absicherung	JP Morgan Chase New York	160.912
	19.04.2022	GBP	19.336.604	USD	25.190.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	265.724
	19.04.2022	SEK	9.304.135	USD	971.720	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26.977
	19.04.2022	GBP	360.160	USD	469.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.949
	19.04.2022	EUR	31.054.943	USD	34.200.343	Absicherung	JP Morgan Chase New York	372.131
	19.04.2022	EUR	1.130.084	USD	1.244.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.542
	19.04.2022	GBP	11.322.464	USD	14.750.226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	155.593
	19.04.2022	GBP	117.149.987	USD	152.615.974	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.609.875
	19.04.2022	EUR	6.154.776	USD	6.778.162	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73.753

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	19.04.2022	GBP	10.730	USD	13.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	147
	19.04.2022	EUR	2.030.945	USD	2.236.649	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.337
	19.04.2022	GBP	102.973.832	USD	134.148.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.415.066
	19.04.2022	NOK	7.918	USD	876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.04.2022	NOK	7.949	USD	879	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.04.2022	CHF	850	USD	907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.04.2022	CHF	848	USD	905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.04.2022	EUR	778	USD	856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	USD	31.601	EUR	28.748	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(403)
	19.04.2022	USD	498	EUR	453	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	20.000	USD	21.985	Absicherung	JP Morgan Chase New York	280
	19.04.2022	USD	7.434	GBP	5.698	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(68)
	19.04.2022	USD	39.816	GBP	30.518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(362)
	19.04.2022	USD	11.262	EUR	10.252	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(151)
	19.04.2022	EUR	19.088	USD	20.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	281
	19.04.2022	GBP	1.986	USD	2.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2022	USD	91.058	GBP	69.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(694)
	19.04.2022	USD	20.029	EUR	18.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(235)
	19.04.2022	USD	81.126	EUR	73.727	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(951)
	19.04.2022	USD	2.639	GBP	2.016	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	GBP	2.707	USD	3.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	USD	20.801	EUR	18.707	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.04.2022	USD	81.890	EUR	73.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(97)
	19.04.2022	GBP	56.461	USD	74.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	19.04.2022	USD	7.391	EUR	6.684	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.04.2022	EUR	4.957	USD	5.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	19.04.2022	EUR	499	USD	551	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	USD	171.519	GBP	130.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.04.2022	EUR	130.967	USD	144.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	892
	19.04.2022	EUR	174.651	USD	193.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.190
	19.04.2022	SEK	94	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	25.081	USD	27.751	Absicherung	JP Morgan Chase New York	171
	19.04.2022	EUR	8.340	USD	9.228	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
	19.04.2022	EUR	161.605	USD	178.809	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.101
	19.04.2022	GBP	232.027	USD	305.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	108
	19.04.2022	SEK	111.150	USD	11.802	Absicherung	JP Morgan Chase New York	129
	19.04.2022	GBP	4.324	USD	5.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	373.333	USD	413.077	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.543
	19.04.2022	EUR	13.604	USD	15.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	93
	19.04.2022	GBP	136.051	USD	179.046	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.04.2022	GBP	1.407.330	USD	1.852.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	656
	19.04.2022	EUR	73.973	USD	81.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	504
	19.04.2022	GBP	129	USD	169	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	24.449	USD	27.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	167
	19.04.2022	GBP	1.241.301	USD	1.633.572	Absicherung	JP Morgan Chase New York	578
	19.04.2022	NOK	93	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	94	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	19.04.2022	CHF	10	USD	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	9	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	7.000	USD	7.741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
	19.04.2022	GBP	17.238	USD	22.759	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(65)
	19.04.2022	USD	132.571	EUR	120.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.226)
	19.04.2022	USD	11.653	EUR	10.564	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
	19.04.2022	EUR	12.185.114	USD	13.440.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124.325
	19.04.2022	USD	795	GBP	599	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	53.299	GBP	40.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	374
	19.04.2022	EUR	4.825	USD	5.311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	60
	19.04.2022	EUR	10.801	USD	11.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	133
	19.04.2022	GBP	357.337	USD	472.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.638)
	19.04.2022	GBP	22.650	USD	29.922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(104)
	19.04.2022	GBP	58.012	USD	76.637	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(266)
	19.04.2022	EUR	78.419	USD	86.378	Absicherung	JP Morgan Chase New York	923
	19.04.2022	EUR	41.735	USD	45.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	491
	19.04.2022	USD	1.665	GBP	1.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	USD	121.041	GBP	91.820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	163
	19.04.2022	USD	175.933	EUR	160.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.721)
	19.04.2022	USD	347.828	EUR	317.274	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.380)
	19.04.2022	USD	12	SEK	116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	34.408	EUR	31.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(532)
	19.04.2022	USD	16.836	EUR	15.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(260)
	19.04.2022	USD	217.091	EUR	198.021	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.358)
	19.04.2022	USD	368.175	GBP	279.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(285)
	19.04.2022	USD	14.331	SEK	136.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(267)
	19.04.2022	USD	6.783	GBP	5.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	USD	584.443	EUR	533.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.040)
	19.04.2022	USD	18.190	EUR	16.592	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(281)
	19.04.2022	USD	212.936	GBP	161.872	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(165)
	19.04.2022	USD	3.264.359	GBP	2.481.525	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.525)
	19.04.2022	USD	146.625	EUR	133.745	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.268)
	19.04.2022	USD	301	GBP	229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	48.160	EUR	43.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(745)
	19.04.2022	USD	1.927.779	GBP	1.465.473	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.491)
	19.04.2022	USD	13	NOK	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	13	NOK	113	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	13	CHF	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	13	CHF	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	12	EUR	11	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	5.359	EUR	4.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(69)
	19.04.2022	USD	30.186	EUR	27.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(387)
	19.04.2022	GBP	38.945	USD	51.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(105)
	19.04.2022	USD	106.515	EUR	97.044	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.520)
	19.04.2022	USD	49.233	EUR	44.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(703)
	19.04.2022	USD	15.366	EUR	14.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(219)
	19.04.2022	USD	26.957	GBP	20.604	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(169)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	19.04.2022	USD	38.792	EUR	35.342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(554)
	19.04.2022	EUR	99.387	USD	110.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	242
	19.04.2022	USD	3.070	EUR	2.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	USD	15.970	GBP	12.159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.04.2022	USD	5.971	EUR	5.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2022	USD	17.742	EUR	15.885	Absicherung	JP Morgan Chase New York	58
	19.04.2022	EUR	978	USD	1.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	GBP	216.252	USD	284.860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(168)
	19.04.2022	EUR	3.429	USD	3.830	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2022	GBP	3.169	USD	4.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	USD	237.555	GBP	180.340	Absicherung	JP Morgan Chase New York	140
	01.04.2022	AUD	20.513	USD	14.824	Handel	JP Morgan Chase New York	580
	01.04.2022	USD	1.793.311	JPY	207.140.317	Handel	Barclays	86.697
	01.04.2022	USD	6.975.072	CAD	8.906.307	Handel	JP Morgan Chase New York	(155.389)
	01.04.2022	USD	64.660.841	GBP	48.299.216	Handel	Barclays	1.067.678
	01.04.2022	USD	171.702.217	EUR	152.835.065	Handel	Barclays	1.650.282
	01.04.2022	GBP	1.500.000	USD	2.010.042	Handel	JP Morgan Chase New York	(35.067)
	01.04.2022	AUD	7.933	USD	5.721	Handel	Barclays	236
	01.04.2022	JPY	2.193.576	USD	18.992	Handel	Barclays	(919)
	01.04.2022	USD	7.317	AUD	10.061	Handel	JP Morgan Chase New York	(239)
	01.04.2022	USD	11.215	JPY	1.286.415	Handel	Barclays	617
	01.04.2022	USD	90.251	CAD	114.339	Handel	JP Morgan Chase New York	(1.289)
	01.04.2022	EUR	100.000	USD	111.032	Handel	Barclays	233
	01.04.2022	AUD	5.307	USD	3.853	Handel	Goldman Sachs	132
	01.04.2022	USD	150.395	CAD	191.262	Handel	Goldman Sachs	(2.731)
	01.04.2022	USD	646.724	GBP	485.776	Handel	Barclays	7.127
	01.04.2022	JPY	28.106.640	USD	243.491	Handel	Barclays	(11.922)
	01.04.2022	USD	8.943	AUD	12.241	Handel	Goldman Sachs	(249)
	01.04.2022	USD	11.032	JPY	1.276.317	Handel	Barclays	516
	01.04.2022	CAD	131.931	USD	104.474	Handel	JP Morgan Chase New York	1.151
	01.04.2022	EUR	600.000	USD	665.631	Handel	Barclays	1.959
	01.04.2022	GBP	328.792	USD	437.157	Handel	Barclays	(4.253)
	01.04.2022	AUD	9.593	USD	7.054	Handel	Barclays	150
	01.04.2022	USD	37.845	CAD	48.155	Handel	JP Morgan Chase New York	(708)
	01.04.2022	USD	1.129	AUD	1.525	Handel	Goldman Sachs	(16)
	01.04.2022	USD	106.063	CAD	134.905	Handel	JP Morgan Chase New York	(1.943)
	01.04.2022	USD	1.164	AUD	1.594	Handel	Goldman Sachs	(34)
	01.04.2022	USD	9.892	JPY	1.143.054	Handel	JP Morgan Chase New York	475
	01.04.2022	CAD	86.247	USD	67.213	Handel	JP Morgan Chase New York	1.837
	01.04.2022	AUD	10.067	USD	7.381	Handel	Barclays	179
	01.04.2022	JPY	1.386.508	USD	11.976	Handel	JP Morgan Chase New York	(552)
	01.04.2022	CAD	158.840	USD	123.894	Handel	JP Morgan Chase New York	3.274
	01.04.2022	GBP	374.027	USD	492.564	Handel	Goldman Sachs	(101)
	01.04.2022	EUR	918.557	USD	1.009.559	Handel	JP Morgan Chase New York	12.473
	01.04.2022	AUD	9.139	USD	6.705	Handel	Goldman Sachs	158
	01.04.2022	CAD	75.440	USD	58.835	Handel	Goldman Sachs	1.562
	01.04.2022	AUD	5.078	USD	3.715	Handel	Goldman Sachs	98
	01.04.2022	CAD	64.000	USD	50.140	Handel	Goldman Sachs	1.099

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b> (Fortsetzung)								
	01.04.2022	AUD	3.193	USD	2.316	Handel	Barclays	82
	01.04.2022	CAD	71.158	USD	55.775	Handel	JP Morgan Chase New York	1.195
	01.04.2022	AUD	5.869	USD	4.223	Handel	Barclays	184
	01.04.2022	CAD	201.181	USD	156.567	Handel	Goldman Sachs	4.500
	01.04.2022	AUD	6.650	USD	4.813	Handel	Barclays	180
	01.04.2022	JPY	1.326.990	USD	11.216	Handel	Goldman Sachs	(283)
	01.04.2022	CAD	52.392	USD	41.203	Handel	JP Morgan Chase New York	743
	01.04.2022	GBP	617.500	USD	813.463	Handel	Barclays	(432)
	01.04.2022	USD	1.796	AUD	2.450	Handel	Barclays	(43)
	01.04.2022	AUD	1.024	USD	756	Handel	JP Morgan Chase New York	13
	01.04.2022	AUD	7.127	USD	5.258	Handel	Goldman Sachs	94
	01.04.2022	AUD	504	USD	374	Handel	JP Morgan Chase New York	4
	01.04.2022	CAD	144.547	USD	114.843	Handel	JP Morgan Chase New York	882
	01.04.2022	EUR	2.500.000	USD	2.754.184	Handel	Barclays	27.441
	01.04.2022	USD	440.202	EUR	400.000	Handel	JP Morgan Chase New York	(4.858)
	01.04.2022	AUD	14.104	USD	10.541	Handel	Barclays	51
	01.04.2022	CAD	107.084	USD	85.082	Handel	Goldman Sachs	650
	01.04.2022	AUD	5.487	USD	4.104	Handel	Barclays	16
	01.04.2022	JPY	935.341	USD	7.689	Handel	JP Morgan Chase New York	17
	01.04.2022	USD	89.238	CAD	112.218	Handel	JP Morgan Chase New York	(605)
	01.04.2022	USD	747	AUD	994	Handel	Barclays	1
	01.04.2022	CAD	61.400	USD	48.982	Handel	Barclays	176
	01.04.2022	AUD	996	USD	749	Handel	Citigroup Global Markets	(1)
	01.04.2022	CAD	194.625	USD	155.815	Handel	JP Morgan Chase New York	3
	01.04.2022	JPY	1.363.760	USD	10.946	Handel	Barclays	290
	06.05.2022	USD	1.410.897	JPY	171.721.422	Handel	Barclays	(4.980)
	03.05.2022	USD	6.618.797	CAD	8.260.540	Handel	JP Morgan Chase New York	6.338
	03.05.2022	USD	60.462.285	GBP	45.964.673	Handel	Barclays	(45.160)
	03.05.2022	USD	166.087.129	EUR	149.116.508	Handel	Barclays	2.801
	03.05.2022	AUD	95.591	USD	71.852	Handel	Barclays	(38)
	03.05.2022	USD	7.762	AUD	10.355	Handel	Barclays	(17)
	03.05.2022	USD	42.895	CAD	53.721	Handel	Barclays	(109)
	06.05.2022	USD	24.755	JPY	3.016.406	Handel	Barclays	(116)
								<b>USD 7.171.721</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
	19.04.2022	NOK	8.103	EUR	814	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	NOK	8.147	EUR	818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	CHF	868	EUR	841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	CHF	875	EUR	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	USD	965	EUR	877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	GBP	694	EUR	820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	01.04.2022	EUR	9.765.208	USD	10.968.945	Handel	Barclays	(93.188)
	01.04.2022	EUR	1.912.346	GBP	1.603.988	Handel	Lloyds	14.273
	01.04.2022	USD	40.000	EUR	36.023	Handel	JP Morgan Chase New York	(73)
	01.04.2022	EUR	23.057	GBP	19.220	Handel	Goldman Sachs	313

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	01.04.2022	GBP	10.590	EUR	12.777	Handel	Citigroup Global Markets	(245)
	01.04.2022	GBP	10.435	EUR	12.566	Handel	Goldman Sachs	(217)
	01.04.2022	USD	79.273	EUR	72.733	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.486)
	01.04.2022	GBP	9.786	EUR	11.658	Handel	Lloyds	(78)
	01.04.2022	USD	55.250	EUR	50.270	Handel	JP Morgan Chase New York	(614)
	01.04.2022	USD	79.994	EUR	72.704	Handel	Barclays	(809)
	01.04.2022	EUR	69.740	USD	76.984	Handel	Barclays	550
	01.04.2022	USD	58.782	EUR	53.561	Handel	Lloyds	(730)
	03.05.2022	EUR	9.639.847	USD	10.732.630	Handel	Royal Bank of Scotland	3.708
	03.05.2022	EUR	1.880.691	GBP	1.592.396	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.368)
								<b>EUR (79.923)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
	19.04.2022	EUR	4.007	CHF	4.104	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	28	CHF	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	10.703	CHF	10.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2022	SEK	8.120	EUR	770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	SEK	8.160	EUR	774	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	USD	2.810.770	EUR	2.552.264	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27.472)
	19.04.2022	CHF	343.190	EUR	332.401	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.799
	19.04.2022	CHF	125.488	EUR	121.544	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.024
	19.04.2022	CHF	415.108	EUR	402.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.386
	19.04.2022	CHF	72.467	EUR	70.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	591
	19.04.2022	CHF	891	EUR	863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	CHF	24.549	EUR	23.777	Absicherung	JP Morgan Chase New York	200
	19.04.2022	NOK	8.179	EUR	822	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	NOK	8.228	EUR	827	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	07.04.2022	GBP	996.510	EUR	1.181.093	Handel	Barclays	(2.177)
	07.04.2022	EUR	169.516	GBP	143.025	Handel	Lloyds	312
	07.04.2022	EUR	178.746	GBP	151.164	Handel	Lloyds	(88)
	07.04.2022	EUR	51.756	USD	56.812	Handel	Lloyds	706
	07.04.2022	EUR	9.661.191	USD	10.714.850	Handel	Barclays	33.022
	07.04.2022	EUR	63.362.646	GBP	52.533.989	Handel	Barclays	1.212.883
	07.04.2022	GBP	208.009	EUR	252.394	Handel	Lloyds	(6.311)
	07.04.2022	GBP	290.387	EUR	349.599	Handel	Goldman Sachs	(6.058)
	07.04.2022	EUR	144.973	GBP	121.780	Handel	Barclays	902
	07.04.2022	EUR	298.201	GBP	250.000	Handel	Barclays	2.440
	07.04.2022	EUR	79.980	USD	88.307	Handel	Barclays	629
	07.04.2022	EUR	221.384	GBP	186.050	Handel	Barclays	1.279
	07.04.2022	EUR	208.826	GBP	174.026	Handel	Barclays	2.946
	07.04.2022	EUR	41.837	USD	46.051	Handel	Barclays	456
	07.04.2022	USD	30.127	EUR	27.419	Handel	Lloyds	(348)
								<b>EUR 1.221.168</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>								
	19.04.2022	NOK	86	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	8	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	763.147	EUR	899.783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.668
	19.04.2022	NOK	87	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	92	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	93	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	8.345	EUR	791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	NOK	8.483	EUR	852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	GBP	727	EUR	860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	784	EUR	927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	71.111.777	EUR	84.094.942	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.493)
	19.04.2022	SEK	8.386	EUR	795	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	NOK	8.447	EUR	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	GBP	7.075.632	EUR	8.367.459	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(248)
	19.04.2022	EUR	26	GBP	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	239.084	GBP	199.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.399
	07.04.2022	EUR	91.888	GBP	77.992	Handel	Barclays	(381)
	07.04.2022	EUR	1.346.722	USD	1.493.543	Handel	Barclays	4.651
	07.04.2022	EUR	24.459.170	GBP	20.280.573	Handel	Barclays	466.461
	07.04.2022	EUR	7.319	USD	8.065	Handel	Citigroup Global Markets	72
	07.04.2022	USD	4.615	EUR	4.258	Handel	Citigroup Global Markets	(112)
	07.04.2022	GBP	208.620	EUR	251.691	Handel	Barclays	(4.884)
	07.04.2022	GBP	98.206	EUR	118.231	Handel	Goldman Sachs	(2.049)
	07.04.2022	USD	4.267	EUR	3.889	Handel	Barclays	(55)
	07.04.2022	USD	4.915	EUR	4.466	Handel	Barclays	(50)
	07.04.2022	EUR	7.335	USD	8.099	Handel	Barclays	58
	07.04.2022	EUR	79.904	GBP	66.588	Handel	Barclays	1.127
	07.04.2022	EUR	3.761	USD	4.139	Handel	Barclays	41
	07.04.2022	EUR	5.313	USD	5.848	Handel	JP Morgan Chase New York	58
	07.04.2022	GBP	344.670	EUR	408.561	Handel	Barclays	(801)
								<b>EUR 467.526</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
	19.04.2022	CHF	23.405.316	EUR	22.669.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	190.907
	19.04.2022	CHF	348.991	EUR	338.020	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.847
	19.04.2022	GBP	9.034.140	EUR	10.683.539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(317)
	19.04.2022	SEK	8.073	EUR	766	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	NOK	8.134	EUR	817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	GBP	34.687.148	EUR	41.020.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.216)
	19.04.2022	USD	14.570	EUR	13.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(142)
	19.04.2022	NOK	8.134	EUR	817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	SEK	8.063	EUR	765	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	CHF	868	EUR	841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	USD	943	EUR	857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	USD	934	EUR	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	SGD	942	EUR	627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	SGD	934	EUR	621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	USD	944	EUR	857	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	USD	830.970	EUR	754.546	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.122)
	19.04.2022	SGD	943	EUR	627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	SGD	934	EUR	621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	GBP	3.309	EUR	3.913	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	23.256	GBP	19.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	84
	19.04.2022	GBP	136.447	EUR	161.940	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(587)
	19.04.2022	USD	42.967	EUR	39.088	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(492)
	19.04.2022	EUR	8.762	GBP	7.367	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	19.04.2022	GBP	11.000	EUR	13.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(74)
	19.04.2022	CHF	393.032	EUR	379.761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.122
	19.04.2022	GBP	27.402	EUR	32.608	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(204)
	19.04.2022	GBP	4.818	EUR	5.734	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.04.2022	GBP	25.643	EUR	30.339	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.04.2022	GBP	39.404	EUR	46.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.04.2022	GBP	8.697	EUR	10.357	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(72)
	19.04.2022	GBP	5.107	EUR	6.082	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2022	EUR	95.353	GBP	79.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	908
	19.04.2022	GBP	45.147	EUR	53.901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(513)
	19.04.2022	GBP	6.054	EUR	7.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(117)
	19.04.2022	GBP	110.786	EUR	133.155	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.146)
	19.04.2022	GBP	16.367	EUR	19.640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(285)
	19.04.2022	GBP	3.975	EUR	4.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
	19.04.2022	EUR	24.642	GBP	20.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	294
	19.04.2022	GBP	30.539	EUR	36.653	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(539)
	19.04.2022	GBP	1.426.267	EUR	1.711.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25.153)
	19.04.2022	GBP	21.857	EUR	26.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(206)
	19.04.2022	GBP	20.753	EUR	24.538	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	57.134	GBP	48.323	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	CHF	13.888	EUR	13.488	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77
	19.04.2022	EUR	94.640	GBP	80.246	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(255)
	19.04.2022	GBP	3.311	EUR	3.904	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2022	EUR	16.939.505	USD	18.653.760	Handel	HSBC	183.749
	19.04.2022	EUR	548.029	SEK	5.710.785	Handel	HSBC	(2.594)
	19.04.2022	EUR	764.657	CAD	1.069.441	Handel	HSBC	(4.371)
	19.04.2022	EUR	33.542.271	GBP	28.184.702	Handel	HSBC	212.905
	19.04.2022	GBP	1.037.430	EUR	1.226.418	Handel	HSBC	383
	19.04.2022	GBP	1.217.320	EUR	1.447.826	Handel	HSBC	(8.298)
	19.04.2022	CAD	7.253	EUR	5.233	Handel	Citigroup Global Markets	(18)
	19.04.2022	EUR	161.201	GBP	134.400	Handel	HSBC	2.270
	19.04.2022	SEK	36.863	EUR	3.536	Handel	HSBC	18
	19.04.2022	SEK	34.112	EUR	3.286	Handel	HSBC	3
	19.04.2022	GBP	350.000	EUR	419.938	Handel	HSBC	(6.049)
	19.04.2022	SEK	34.958	EUR	3.382	Handel	HSBC	(12)
	19.04.2022	EUR	717.762	GBP	600.000	Handel	HSBC	8.244

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	CAD	10.595	EUR	7.715	Handel	HSBC	(96)
	19.04.2022	SEK	29.327	EUR	2.834	Handel	HSBC	(7)
	19.04.2022	EUR	89.693	USD	100.019	Handel	HSBC	(150)
	19.04.2022	SEK	38.640	EUR	3.735	Handel	HSBC	(9)
	19.04.2022	EUR	180.794	GBP	152.969	Handel	HSBC	(98)
								<b>EUR 544.590</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>								
	19.04.2022	USD	969	EUR	880	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	USD	958	EUR	870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	SEK	8.230	EUR	781	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	NOK	8.271	EUR	831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	NOK	8.323	EUR	836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	12.04.2022	EUR	33.151.013	GBP	28.010.120	Handel	Lloyds	19.700
	12.04.2022	EUR	34.285.188	USD	39.233.501	Handel	Lloyds	(964.355)
	12.04.2022	EUR	109.298	AUD	175.664	Handel	Lloyds	(9.238)
	12.04.2022	USD	181.194	EUR	158.817	Handel	Barclays	3.976
	12.04.2022	USD	1.299.505	EUR	1.147.431	Handel	UBS	20.105
	12.04.2022	USD	7.818.665	GBP	5.785.561	Handel	Lloyds	181.375
	12.04.2022	USD	173.571	EUR	152.539	Handel	UBS	3.405
	12.04.2022	EUR	65.110	USD	74.078	Handel	Barclays	(1.446)
	12.04.2022	EUR	256.456	USD	290.900	Handel	HSBC	(4.904)
	12.04.2022	USD	115.126	EUR	103.186	Handel	Barclays	248
	12.04.2022	USD	93.059	EUR	82.658	Handel	UBS	950
	12.04.2022	GBP	78.226	EUR	93.133	Handel	HSBC	(605)
	12.04.2022	EUR	85.181	USD	95.350	Handel	HSBC	(486)
	12.04.2022	GBP	48.532	EUR	58.175	Handel	HSBC	(770)
	12.04.2022	EUR	51.015	USD	56.626	Handel	Royal Bank of Scotland	140
	12.04.2022	GBP	3.238.776	EUR	3.882.816	Handel	JP Morgan Chase New York	(51.881)
	12.04.2022	USD	156.609	EUR	141.246	Handel	HSBC	(541)
	12.04.2022	GBP	105.141	EUR	126.820	Handel	Barclays	(2.456)
	12.04.2022	USD	158.648	EUR	145.183	Handel	Barclays	(2.646)
	12.04.2022	GBP	141.033	EUR	169.428	Handel	Barclays	(2.610)
	12.04.2022	USD	138.657	EUR	126.573	Handel	Lloyds	(1.997)
	12.04.2022	GBP	62.432	EUR	74.825	Handel	Royal Bank of Scotland	(979)
	12.04.2022	EUR	531.648	USD	583.749	Handel	HSBC	7.183
	12.04.2022	USD	200.000	EUR	181.093	Handel	HSBC	(1.404)
	12.04.2022	GBP	910.000	EUR	1.083.825	Handel	HSBC	(7.445)
	12.04.2022	EUR	197.091	USD	218.032	Handel	Barclays	1.201
	12.04.2022	EUR	74.450	GBP	62.563	Handel	Barclays	449
	12.04.2022	EUR	772.355	USD	850.436	Handel	HSBC	8.286
	12.04.2022	EUR	67.854	USD	74.595	Handel	HSBC	834
	12.04.2022	EUR	149.577	USD	166.991	Handel	Lloyds	(456)
	12.04.2022	EUR	74.493	GBP	63.182	Handel	Barclays	(240)
								<b>EUR (806.574)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>								
	19.04.2022	EUR	5.109.465	USD	5.626.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61.227
	19.04.2022	EUR	1.953.376	USD	2.151.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.407
	19.04.2022	EUR	11.451.518	USD	12.611.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137.224
	19.04.2022	SGD	98.034	USD	71.747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	685
	19.04.2022	EUR	4.359.980	USD	4.801.581	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52.246
	19.04.2022	EUR	143.623	USD	158.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.721
	19.04.2022	EUR	361.217	USD	397.803	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.328
	19.04.2022	SEK	7.576	USD	791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	NOK	7.611	USD	842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2022	EUR	1.641.265	USD	1.807.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19.667
	19.04.2022	EUR	827	USD	909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2022	USD	8.313	EUR	7.563	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(106)
	19.04.2022	EUR	165	USD	181	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	873	USD	959	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	USD	16.111	EUR	14.665	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(216)
	19.04.2022	EUR	520	USD	572	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	USD	10.217	EUR	9.285	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(120)
	19.04.2022	EUR	95	USD	105	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	40	USD	45	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	5.367	EUR	4.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	USD	8.291	EUR	7.456	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	USD	1.094	EUR	989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	EUR	1.725	USD	1.907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	EUR	254	USD	281	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	57.216	USD	62.902	Absicherung	JP Morgan Chase New York	795
	19.04.2022	EUR	21.833	USD	24.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	303
	19.04.2022	EUR	129.844	USD	142.748	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.803
	19.04.2022	SGD	1.098	USD	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	EUR	48.433	USD	53.246	Absicherung	JP Morgan Chase New York	673
	19.04.2022	EUR	1.618	USD	1.779	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	EUR	4.037	USD	4.439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56
	19.04.2022	SEK	85	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	85	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18.630	USD	20.481	Absicherung	JP Morgan Chase New York	259
	19.04.2022	EUR	9.985	USD	11.042	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
	19.04.2022	EUR	5.000	USD	5.529	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	19.04.2022	EUR	792	USD	876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	3.261	EUR	2.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2022	USD	9.222	EUR	8.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(85)
	19.04.2022	EUR	136.417	USD	150.183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.685
	19.04.2022	EUR	10.050	USD	11.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124
	19.04.2022	USD	2.699	EUR	2.456	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35)
	19.04.2022	USD	25.490	EUR	23.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(327)
	19.04.2022	EUR	1.000	USD	1.098	Absicherung	JP Morgan Chase New York	16
	19.04.2022	USD	2.521	EUR	2.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(36)
	19.04.2022	EUR	680	USD	747	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2022	EUR	3.100	USD	3.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	20	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	8.510	USD	9.453	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.04.2022	USD	85	EUR	76	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	10.000	USD	11.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	USD	1.515	EUR	1.356	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	EUR	18.798	USD	20.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(69)
	19.04.2022	EUR	3	USD	4	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 305.532</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>								
	19.04.2022	EUR	186.592	USD	205.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.236
	19.04.2022	EUR	311.764	USD	343.341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.736
	19.04.2022	EUR	471.572	USD	519.335	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.651
	19.04.2022	EUR	406.769	USD	447.968	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.874
	19.04.2022	SGD	26.812	USD	19.622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	187
	19.04.2022	SEK	7.362	USD	769	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.04.2022	NOK	7.437	USD	823	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2022	EUR	2.823	USD	3.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	EUR	4.718	USD	5.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	37
	19.04.2022	EUR	7.157	USD	7.911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	56
	19.04.2022	EUR	6.155	USD	6.805	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	19.04.2022	SGD	402	USD	297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	SEK	110	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	111	USD	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	18.170	EUR	16.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(233)
	19.04.2022	USD	5.031	EUR	4.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54)
	19.04.2022	EUR	6.834	USD	7.611	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	SGD	278	USD	205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	77	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	9.990	USD	11.158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)
	19.04.2022	USD	25.185	EUR	22.548	Absicherung	JP Morgan Chase New York	82
	29.04.2022	USD	483.578	MXN	10.095.000	Handel	JP Morgan Chase New York	(20.193)
	29.04.2022	USD	1.015.667	EUR	884.421	Handel	Lloyds	30.746
								<b>USD 27.205</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
	19.04.2022	EUR	1.047.792	USD	1.153.917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.556
	19.04.2022	EUR	2.740.230	USD	3.017.774	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32.836
	19.04.2022	EUR	12.065.503	USD	13.287.558	Absicherung	JP Morgan Chase New York	144.581
	19.04.2022	EUR	11.339.509	USD	12.488.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135.881
	19.04.2022	SGD	168.330	USD	123.193	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.176
	19.04.2022	SGD	877.239	USD	642.012	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.127
	19.04.2022	SEK	7.627	USD	797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	158.159	USD	174.178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.895
	19.04.2022	NOK	7.639	USD	845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2022	SGD	199	USD	146	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	647	EUR	588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	SGD	5.265	USD	3.884	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	SGD	9.918	USD	7.324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	USD	438.992	SGD	594.441	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(205)
	19.04.2022	EUR	11.380	USD	12.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	EUR	29.815	USD	32.989	Absicherung	JP Morgan Chase New York	203
	19.04.2022	EUR	132.273	USD	146.354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	901
	19.04.2022	EUR	123.378	USD	136.512	Absicherung	JP Morgan Chase New York	840
	19.04.2022	SGD	1.881	USD	1.388	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	SEK	82	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	1.733	USD	1.917	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2022	NOK	82	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	31	EUR	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	7.542	EUR	6.838	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(70)
	19.04.2022	USD	93.111	EUR	84.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.042)
	19.04.2022	EUR	20.766	USD	22.873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	244
	19.04.2022	USD	22.981	EUR	20.863	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(245)
	19.04.2022	USD	130.379	EUR	118.927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.017)
	19.04.2022	USD	97.546	EUR	88.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.251)
	19.04.2022	SGD	693	USD	511	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	USD	1.001	EUR	912	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	USD	974	EUR	877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	139.081	USD	154.892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(57)
	19.04.2022	USD	519.728	EUR	465.320	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.702
	19.04.2022	EUR	483	USD	539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	USD	1.841	SGD	2.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
								<b>USD 334.184</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>								
	19.04.2022	EUR	573.448	USD	631.529	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.872
	19.04.2022	EUR	630.209	USD	694.040	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.552
	19.04.2022	EUR	63.016.278	USD	69.398.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	755.124
	19.04.2022	SGD	649.789	USD	475.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.538
	19.04.2022	EUR	261.647	USD	288.148	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.135
	19.04.2022	EUR	246.539	USD	271.510	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.954
	19.04.2022	SEK	8.032	USD	839	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2022	SEK	8.113	USD	847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	CHF	874	USD	932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	GBP	686	USD	894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	46.028	USD	50.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	552
	19.04.2022	EUR	776	USD	854	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	NOK	8.116	USD	898	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b> (Fortsetzung)	19.04.2022	NOK	8.170	USD	904	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.04.2022	SGD	1.235.064	USD	903.888	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.626
	19.04.2022	USD	1.536	SGD	2.096	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2022	USD	110	EUR	100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	SGD	12.829	USD	9.406	Absicherung	JP Morgan Chase New York	73
	19.04.2022	SGD	262	USD	192	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	SGD	2.779	USD	2.034	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	SGD	108	USD	80	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	1.793	USD	1.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	10.257	USD	11.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	19.04.2022	EUR	11.262	USD	12.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	19.04.2022	EUR	1.131.834	USD	1.255.193	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.842
	19.04.2022	SGD	11.611	USD	8.571	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	EUR	4.677	USD	5.187	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2022	EUR	4.403	USD	4.883	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	SEK	142	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	145	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	16	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	12	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	825	USD	915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	14	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	143	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	NOK	145	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	22.527	USD	16.629	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2022	USD	25.052	EUR	22.530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2022	USD	28.143	SGD	38.109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2022	SGD	15.592	USD	11.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	USD	71	EUR	64	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	48.761	SGD	66.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(100)
	19.04.2022	SGD	46.458	USD	34.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2022	USD	62.211	SGD	84.314	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(83)
	19.04.2022	SGD	21.619	USD	15.952	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21
	19.04.2022	EUR	127	USD	140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	2.555	SGD	3.469	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	SGD	12.832	USD	9.450	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.04.2022	SGD	700	USD	516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	SGD	15.516	USD	11.428	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	19.04.2022	SGD	14	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	35.298	EUR	32.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(377)
	19.04.2022	SGD	10.578	USD	7.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	USD	3.383	EUR	3.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2022	USD	2.973	EUR	2.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.04.2022	USD	10	EUR	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	11.437	SGD	15.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(65)
	19.04.2022	USD	17.549	EUR	15.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(225)
	19.04.2022	USD	30.843	EUR	28.060	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(395)
	19.04.2022	USD	8.959	SGD	12.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
	19.04.2022	USD	174	EUR	159	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	USD	94	SGD	128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	SGD	18.172	USD	13.348	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	SGD	49	USD	36	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	9.827	USD	7.247	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	SGD	19.966	USD	14.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	2.478	USD	2.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2022	EUR	2.277	USD	2.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	EUR	8	USD	9	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	15.402	USD	11.387	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
								<b>USD 793.399</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>								
	19.04.2022	EUR	1.054.313	USD	1.161.099	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.634
	19.04.2022	SGD	621.702	USD	454.996	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.342
	19.04.2022	SGD	47.527	USD	34.783	Absicherung	JP Morgan Chase New York	332
	19.04.2022	EUR	703.596	USD	774.859	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.431
	19.04.2022	EUR	13.243.571	USD	14.584.946	Absicherung	JP Morgan Chase New York	158.698
	19.04.2022	GBP	659	USD	858	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	SGD	1.236	USD	905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	AUD	1.067	USD	767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34
	19.04.2022	AUD	921	USD	663	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.04.2022	SEK	7.735	USD	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	USD	36.845	SGD	50.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(286)
	19.04.2022	SGD	200	USD	147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	19.084	USD	20.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	268
	19.04.2022	USD	24.370	EUR	22.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(326)
	19.04.2022	USD	2.269	SGD	3.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2022	EUR	9.545	USD	10.486	Absicherung	JP Morgan Chase New York	140
	19.04.2022	SGD	1.240	USD	911	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	USD	4.615	EUR	4.194	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(54)
	19.04.2022	USD	2.156	SGD	2.919	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	EUR	9.428	USD	10.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2022	USD	7.452	EUR	6.739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.04.2022	SGD	261.563	USD	192.860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	394
	19.04.2022	USD	1.238	EUR	1.119	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	SGD	43.582	USD	32.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	43
	19.04.2022	USD	69	SGD	93	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	5.925	USD	6.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	19.04.2022	USD	582	SGD	790	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	USD	5.616	SGD	7.626	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.04.2022	EUR	56.320	USD	62.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	575
	19.04.2022	USD	26	SGD	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	171	USD	126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	31.763	EUR	28.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(356)
	19.04.2022	USD	1.195	SGD	1.622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	SGD	180	USD	133	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	242	USD	178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	SGD	87	USD	64	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	9.127	USD	10.032	Absicherung	JP Morgan Chase New York	129
	19.04.2022	USD	2.372	SGD	3.229	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	EUR	12.005	USD	13.176	Absicherung	JP Morgan Chase New York	188
	19.04.2022	SGD	710	USD	523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	2.392	EUR	2.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	USD	6	SGD	8	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	10	USD	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	11.792	USD	13.171	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(43)
	19.04.2022	EUR	17.983	USD	20.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)
	19.04.2022	SGD	13.416	USD	9.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	SGD	645	USD	477	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	12.361	USD	13.817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.04.2022	EUR	239.211	USD	267.386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.080)
	19.04.2022	GBP	12	USD	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	23	USD	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	AUD	19	USD	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	AUD	13	USD	10	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	138	USD	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	29.04.2022	PHP	24.131.185	USD	467.152	Handel	JP Morgan Chase New York	(2.240)
	29.04.2022	USD	1.991.836	CNY	12.750.337	Handel	Barclays	(12.914)
	29.04.2022	USD	1.537.332	SGD	2.067.860	Handel	Barclays	9.573
	29.04.2022	USD	915.066	THB	30.172.944	Handel	Citigroup Global Markets	7.493
	29.04.2022	MYR	1.265.571	USD	301.865	Handel	Barclays	(1.691)
	29.04.2022	USD	1.718.414	CNY	10.985.618	Handel	UBS	(8.860)
								<b>USD 175.291</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>								
	07.06.2022	JPY	85.065.000	EUR	664.531	Handel	Barclays	(35.170)
	07.06.2022	EUR	2.113.278	GBP	1.780.000	Handel	Barclays	13.092
	07.06.2022	EUR	499.203	USD	553.000	Handel	Barclays	3.506
	07.06.2022	AUD	1.030.000	EUR	681.680	Handel	Barclays	12.482
	07.06.2022	EUR	11.761	GBP	10.000	Handel	Barclays	(38)
								<b>EUR (6.128)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
	19.04.2022	EUR	8.218.884	USD	9.051.334	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98.487
	19.04.2022	EUR	2.036.742	USD	2.243.034	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.406
	19.04.2022	EUR	808.647	USD	890.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.690
	19.04.2022	GBP	335.629	USD	437.237	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.612
	19.04.2022	EUR	768	USD	846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	SEK	7.723	USD	807	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	USD	15.936	EUR	14.497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(203)
	19.04.2022	USD	3.692	EUR	3.361	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49)
	19.04.2022	EUR	5.584	USD	6.144	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	251.707	USD	279.141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.077
	19.04.2022	EUR	62.378	USD	69.177	Absicherung	JP Morgan Chase New York	267
	19.04.2022	EUR	24.809	USD	27.513	Absicherung	JP Morgan Chase New York	106
	19.04.2022	GBP	10.379	USD	13.655	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	24	USD	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	236	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	138	USD	152	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	28	USD	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	23.071	EUR	20.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(296)
	19.04.2022	USD	15.910	EUR	14.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(204)
	19.04.2022	USD	7.141	EUR	6.393	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2022	EUR	45	USD	50	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	07.06.2022	JPY	464.140.000	USD	4.016.752	Handel	Barclays	(185.869)
	07.06.2022	AUD	1.480.000	USD	1.085.021	Handel	Lloyds	27.700
								<b>USD (20.139)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
	19.04.2022	EUR	12.531.836	USD	13.801.123	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150.169
	19.04.2022	SGD	6.870	USD	5.028	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	19.04.2022	EUR	195.165	USD	214.933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.339
	19.04.2022	CHF	880	USD	939	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	EUR	34.851.085	USD	38.380.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	417.621
	19.04.2022	EUR	19.136.907	USD	21.075.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	229.318
	19.04.2022	EUR	782	USD	862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	2.493.614	USD	2.746.180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29.881
	19.04.2022	SGD	168.380	USD	123.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.176
	19.04.2022	USD	5.049	EUR	4.593	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(64)
	19.04.2022	USD	3.158	EUR	2.873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.04.2022	USD	10.795	EUR	9.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(144)
	19.04.2022	USD	112.626	EUR	102.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.507)
	19.04.2022	EUR	99	USD	108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	45.284	EUR	41.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(531)
	19.04.2022	EUR	296.046	USD	328.312	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.267
	19.04.2022	SGD	163	USD	120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	4.622	USD	5.126	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2022	CHF	21	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	821.561	USD	911.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.515
	19.04.2022	EUR	450.797	USD	499.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.929
	19.04.2022	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	58.729	USD	65.130	Absicherung	JP Morgan Chase New York	251
	19.04.2022	SGD	3.992	USD	2.947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	USD	2.797	EUR	2.516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	150	USD	166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	9.923	EUR	8.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
	19.04.2022	USD	5.444	EUR	4.923	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(37)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	USD	15.058	EUR	13.617	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(101)
	19.04.2022	USD	42.055	EUR	38.030	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(282)
	19.04.2022	USD	4.409	EUR	3.997	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(41)
	19.04.2022	USD	17.705	EUR	16.051	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164)
	19.04.2022	USD	3.566	EUR	3.239	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.04.2022	USD	35.919	EUR	32.609	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(384)
	19.04.2022	USD	10.087	EUR	9.158	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
	19.04.2022	USD	13	EUR	12	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	4.885	USD	5.369	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	19.04.2022	USD	38.724	EUR	35.230	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(496)
	19.04.2022	USD	16.907	EUR	15.382	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(217)
	19.04.2022	SGD	224	USD	165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	11.493	EUR	10.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(164)
	19.04.2022	USD	152	EUR	139	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	USD	2.176	EUR	1.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2022	USD	99.983	EUR	90.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(219)
	19.04.2022	USD	13.412	EUR	12.074	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2022	USD	33.628	EUR	30.273	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(74)
	19.04.2022	EUR	5.990	USD	6.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2022	EUR	8.017	USD	8.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2022	SGD	1.218	USD	900	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	12.04.2022	SGD	16.213	USD	12.056	Handel	HSBC	(77)
	12.04.2022	CNY	2.960.051	USD	463.145	Handel	Barclays	2.788
	12.04.2022	KRW	79.474.929	USD	66.183	Handel	HSBC	(696)
	12.04.2022	IDR	355.453.455	USD	24.595	Handel	HSBC	163
	12.04.2022	RUB	793.606	USD	10.331	Handel	UBS	(785)
	12.04.2022	THB	602.030	USD	18.288	Handel	HSBC	(181)
	12.04.2022	SEK	215.418	USD	23.584	Handel	Royal Bank of Scotland	(464)
	12.04.2022	JPY	55.039.397	USD	477.634	Handel	Royal Bank of Scotland	(24.072)
	12.04.2022	CAD	30.011	USD	23.620	Handel	UBS	406
	12.04.2022	USD	212.273	GBP	156.750	Handel	Lloyds	5.907
	12.04.2022	EUR	637.422	USD	729.382	Handel	HSBC	(19.911)
	12.04.2022	AUD	53.268	USD	37.936	Handel	Royal Bank of Scotland	2.071
	12.04.2022	USD	765	ZAR	11.901	Handel	Lloyds	(49)
	12.04.2022	NOK	65.310	USD	7.405	Handel	HSBC	63
	12.04.2022	MXN	2.152.265	USD	103.170	Handel	Goldman Sachs	4.534
	12.04.2022	CHF	28.256	USD	30.659	Handel	HSBC	58
	12.04.2022	NZD	14.125	USD	9.357	Handel	Royal Bank of Scotland	466
	12.04.2022	GBP	3.152	USD	4.269	Handel	HSBC	(119)
	12.04.2022	USD	3.171	EUR	2.780	Handel	HSBC	77
	12.04.2022	CNY	11.966	USD	1.873	Handel	HSBC	10
	12.04.2022	USD	8.102	JPY	931.855	Handel	Royal Bank of Scotland	423
	12.04.2022	EUR	3.887	USD	4.400	Handel	HSBC	(73)
	12.04.2022	ZAR	11.901	USD	790	Handel	UBS	24
	12.04.2022	USD	1.544	MXN	31.599	Handel	HSBC	(37)
	12.04.2022	JPY	339.839	USD	2.961	Handel	HSBC	(161)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	12.04.2022	USD	1.570	CNY	9.983	Handel	HSBC	(1)
	12.04.2022	USD	2.716	GBP	1.993	Handel	UBS	92
	12.04.2022	EUR	1.706	USD	1.941	Handel	HSBC	(42)
	12.04.2022	EUR	48.968	USD	55.602	Handel	HSBC	(1.099)
	12.04.2022	USD	95.747	JPY	11.012.013	Handel	HSBC	4.999
	12.04.2022	USD	79.789	GBP	58.746	Handel	UBS	2.449
	12.04.2022	USD	55.126	GBP	40.666	Handel	UBS	1.588
	12.04.2022	USD	1.513	JPY	174.530	Handel	Barclays	74
	01.04.2022	USD	47.629	JPY	5.501.469	Handel	Barclays	2.303
	01.04.2022	USD	86.580	CAD	110.552	Handel	JP Morgan Chase New York	(1.929)
	01.04.2022	USD	1.507.467	GBP	1.126.093	Handel	Lloyds	24.797
	01.04.2022	USD	5.068.704	EUR	4.513.399	Handel	HSBC	46.870
	12.04.2022	USD	2.166	GBP	1.618	Handel	HSBC	36
	01.04.2022	GBP	22.411	USD	30.000	Handel	Barclays	(493)
	01.04.2022	JPY	57.028	USD	494	Handel	Barclays	(24)
	01.04.2022	EUR	25.000	USD	28.093	Handel	Barclays	(277)
	01.04.2022	USD	290	JPY	33.230	Handel	Barclays	16
	01.04.2022	USD	2.080	CAD	2.635	Handel	JP Morgan Chase New York	(30)
	12.04.2022	JPY	433.731	USD	3.779	Handel	HSBC	(205)
	12.04.2022	USD	1.764	CAD	2.235	Handel	HSBC	(25)
	12.04.2022	USD	2.951	GBP	2.199	Handel	HSBC	56
	01.04.2022	USD	3.619	CAD	4.602	Handel	Goldman Sachs	(66)
	01.04.2022	USD	12.178	GBP	9.147	Handel	Barclays	134
	12.04.2022	USD	3.562	GBP	2.677	Handel	HSBC	38
	12.04.2022	EUR	2.425	USD	2.692	Handel	HSBC	7
	07.04.2022	USD	6.087.144	GBP	4.551.552	Handel	Barclays	94.722
	07.04.2022	USD	33.247.077	EUR	29.983.345	Handel	HSBC	(120.285)
	01.04.2022	GBP	5.660	USD	7.574	Handel	Goldman Sachs	(122)
	01.04.2022	USD	272	JPY	31.458	Handel	Barclays	13
	01.04.2022	CAD	2.951	USD	2.337	Handel	JP Morgan Chase New York	26
	12.04.2022	GBP	1.854	USD	2.480	Handel	UBS	(39)
	12.04.2022	USD	2.505	EUR	2.259	Handel	HSBC	(10)
	07.04.2022	USD	135.982	GBP	102.830	Handel	Royal Bank of Scotland	599
	07.04.2022	USD	431.873	EUR	395.470	Handel	Royal Bank of Scotland	(8.230)
	01.04.2022	USD	894	CAD	1.138	Handel	JP Morgan Chase New York	(17)
	12.04.2022	GBP	134.547	EUR	162.620	Handel	HSBC	(3.865)
	12.04.2022	USD	50.125	MXN	1.056.771	Handel	Goldman Sachs	(2.764)
	07.04.2022	GBP	24.334	USD	32.008	Handel	Goldman Sachs	29
	07.04.2022	EUR	157.784	USD	171.001	Handel	Goldman Sachs	4.592
	01.04.2022	USD	2.725	CAD	3.466	Handel	JP Morgan Chase New York	(50)
	07.04.2022	EUR	312.156	USD	340.113	Handel	Goldman Sachs	7.274
	07.04.2022	GBP	31.558	USD	41.423	Handel	UBS	126
	01.04.2022	USD	304	JPY	35.183	Handel	JP Morgan Chase New York	15
	01.04.2022	CAD	1.845	USD	1.438	Handel	JP Morgan Chase New York	39
	01.04.2022	GBP	7.663	USD	10.058	Handel	UBS	31
	07.04.2022	EUR	83.179	USD	91.438	Handel	JP Morgan Chase New York	1.129



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	07.04.2022	EUR	101.920	USD	112.080	Handel	Lloyds	1.343
	07.04.2022	EUR	104.990	USD	116.068	Handel	Lloyds	771
	01.04.2022	JPY	42.636	USD	368	Handel	JP Morgan Chase New York	(17)
	01.04.2022	CAD	4.066	USD	3.172	Handel	JP Morgan Chase New York	84
	01.04.2022	GBP	6.486	USD	8.542	Handel	Goldman Sachs	(2)
	01.04.2022	EUR	25.222	USD	27.721	Handel	JP Morgan Chase New York	342
	07.06.2022	USD	3.307.465	GBP	2.515.000	Handel	HSBC	(2.965)
	07.04.2022	USD	132.689	EUR	120.160	Handel	Lloyds	(1.033)
	07.04.2022	EUR	200.000	USD	220.950	Handel	Lloyds	1.623
	01.04.2022	CAD	1.938	USD	1.511	Handel	Goldman Sachs	40
	01.04.2022	CAD	1.598	USD	1.252	Handel	Goldman Sachs	27
	12.04.2022	USD	1.486	CNY	9.451	Handel	HSBC	(2)
	12.04.2022	USD	1.785	CHF	1.661	Handel	Goldman Sachs	(21)
	12.04.2022	EUR	4.502	USD	4.955	Handel	HSBC	55
	07.04.2022	USD	15.211	GBP	11.667	Handel	Goldman Sachs	(150)
	01.04.2022	CAD	1.573	USD	1.233	Handel	JP Morgan Chase New York	26
	07.04.2022	USD	97.893	GBP	75.000	Handel	Lloyds	(850)
	01.04.2022	GBP	5.841	USD	7.615	Handel	Lloyds	76
	01.04.2022	CAD	5.016	USD	3.904	Handel	Goldman Sachs	112
	07.04.2022	GBP	18.145	USD	23.710	Handel	Royal Bank of Scotland	179
	07.04.2022	EUR	113.591	USD	125.072	Handel	Lloyds	1.339
	01.04.2022	JPY	40.806	USD	345	Handel	Goldman Sachs	(9)
	01.04.2022	CAD	1.271	USD	1.000	Handel	JP Morgan Chase New York	18
	07.04.2022	USD	140.109	EUR	126.850	Handel	HSBC	(1.058)
	07.04.2022	USD	187.794	EUR	170.123	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.530)
	07.04.2022	USD	36.019	GBP	27.412	Handel	HSBC	(72)
	07.04.2022	USD	183.764	EUR	166.949	Handel	Royal Bank of Scotland	(2.027)
	07.04.2022	USD	23.649	GBP	17.903	Handel	Lloyds	78
	01.04.2022	CAD	3.936	USD	3.128	Handel	JP Morgan Chase New York	24
	07.04.2022	USD	218.894	EUR	198.860	Handel	Lloyds	(2.409)
	01.04.2022	CAD	2.561	USD	2.035	Handel	Goldman Sachs	16
	12.04.2022	USD	2.206	EUR	2.004	Handel	HSBC	(25)
	07.04.2022	USD	131.816	GBP	100.000	Handel	Barclays	159
	01.04.2022	JPY	33.310	USD	274	Handel	JP Morgan Chase New York	1
	01.04.2022	USD	2.096	CAD	2.636	Handel	JP Morgan Chase New York	(14)
	01.04.2022	JPY	967.150	USD	7.924	Handel	JP Morgan Chase New York	44
	01.04.2022	CAD	1.412	USD	1.126	Handel	Barclays	4
	07.04.2022	EUR	80.398	USD	88.343	Handel	JP Morgan Chase New York	1.129
	01.04.2022	CAD	4.709	USD	3.770	Handel	JP Morgan Chase New York	0
	01.04.2022	JPY	29.548	USD	237	Handel	Barclays	6
	12.04.2022	GBP	1.549	USD	2.038	Handel	Barclays	2
	07.04.2022	GBP	101.370	USD	132.731	Handel	UBS	730
	12.04.2022	USD	34.882	JPY	4.313.537	Handel	HSBC	(664)
	07.04.2022	USD	97.785	EUR	87.814	Handel	Royal Bank of Scotland	60
	07.04.2022	USD	24.949	GBP	19.010	Handel	UBS	(79)
	06.05.2022	USD	35.612	JPY	4.334.518	Handel	Royal Bank of Scotland	(127)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	03.05.2022	USD	75.792	CAD	94.611	Handel	UBS	57
	03.05.2022	USD	1.429.580	GBP	1.087.179	Handel	Lloyds	(1.570)
	03.05.2022	USD	4.967.985	EUR	4.463.178	Handel	Lloyds	(3.050)
	12.04.2022	USD	3.143	EUR	2.815	Handel	JP Morgan Chase New York	9
	03.05.2022	USD	963	CAD	1.205	Handel	Barclays	(2)
	06.05.2022	USD	625	JPY	76.164	Handel	Barclays	(3)
								<b>USD 846.360</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>								
	19.04.2022	EUR	855	USD	942	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	79.874	USD	87.964	Absicherung	JP Morgan Chase New York	962
	19.04.2022	EUR	874	USD	963	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	872	USD	960	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	5.706	USD	6.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	19.04.2022	EUR	2.434	USD	2.699	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	865	USD	952	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	61	USD	68	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	63	USD	69	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	62	USD	69	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	62	USD	68	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	26	USD	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	27	USD	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	27	USD	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	26	USD	29	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 1.056</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
	19.04.2022	EUR	81.349.183	USD	89.588.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	974.807
	19.04.2022	EUR	21.468.255	USD	23.642.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	257.254
	19.04.2022	EUR	45.663.590	USD	50.288.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	547.187
	19.04.2022	EUR	47.023	USD	51.786	Absicherung	JP Morgan Chase New York	563
	19.04.2022	CHF	1.093.453	USD	1.166.647	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22.321
	19.04.2022	USD	2.650	EUR	2.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
	19.04.2022	EUR	27.741	USD	30.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	389
	19.04.2022	EUR	1.950.195	USD	2.143.742	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27.348
	19.04.2022	USD	12.765	EUR	11.620	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(171)
	19.04.2022	USD	14.003	EUR	12.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(187)
	19.04.2022	USD	2.105.425	EUR	1.916.526	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28.167)
	19.04.2022	EUR	3.921.825	USD	4.335.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30.572
	19.04.2022	EUR	1.035.149	USD	1.144.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.069
	19.04.2022	EUR	2.238.541	USD	2.474.646	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17.450
	19.04.2022	EUR	2.269	USD	2.509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	CHF	52.816	USD	56.184	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.246
	19.04.2022	EUR	21.380	USD	23.526	Absicherung	JP Morgan Chase New York	276
	19.04.2022	EUR	13.519	USD	14.876	Absicherung	JP Morgan Chase New York	174

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	USD	740.291	EUR	672.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8.677)
	19.04.2022	EUR	86.698	USD	96.404	Absicherung	JP Morgan Chase New York	115
	19.04.2022	EUR	27.263	USD	30.315	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	19.04.2022	EUR	20.133	USD	22.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
	19.04.2022	EUR	35.605	USD	39.371	Absicherung	JP Morgan Chase New York	267
	19.04.2022	USD	2.657.484	EUR	2.403.269	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17.988)
	19.04.2022	EUR	2.760.648	USD	3.054.535	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18.806
	19.04.2022	EUR	728.526	USD	806.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.963
	19.04.2022	EUR	1.531.182	USD	1.694.185	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.431
	19.04.2022	EUR	1.597	USD	1.767	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2022	CHF	37.183	USD	39.880	Absicherung	JP Morgan Chase New York	551
	19.04.2022	EUR	255.897	USD	282.980	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.902
	19.04.2022	EUR	20.464	USD	22.630	Absicherung	JP Morgan Chase New York	152
	19.04.2022	USD	37.757	EUR	34.143	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(254)
	19.04.2022	USD	34.758	EUR	31.510	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(321)
	19.04.2022	EUR	31.348	USD	34.579	Absicherung	JP Morgan Chase New York	320
	19.04.2022	USD	231.297	EUR	209.686	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.138)
	19.04.2022	EUR	5.277	USD	5.821	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	19.04.2022	USD	63.803	EUR	57.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(716)
	19.04.2022	EUR	28.347	USD	31.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	350
	19.04.2022	EUR	256.678	USD	282.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.172
	19.04.2022	USD	69.304	EUR	62.918	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(740)
	19.04.2022	USD	1.176	EUR	1.068	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(13)
	19.04.2022	EUR	51.680	USD	56.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	729
	19.04.2022	EUR	9.600	USD	10.552	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135
	19.04.2022	USD	117.961	EUR	107.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.512)
	19.04.2022	EUR	56.720	USD	62.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	889
	19.04.2022	EUR	4.039	USD	4.434	Absicherung	JP Morgan Chase New York	63
	19.04.2022	EUR	53.827	USD	59.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	844
	19.04.2022	EUR	370.027	USD	406.141	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.798
	19.04.2022	USD	9.960	EUR	8.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2022	EUR	44.521	USD	49.455	Absicherung	JP Morgan Chase New York	108
	19.04.2022	EUR	137.309	USD	152.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	334
	19.04.2022	EUR	2.209.034	USD	2.460.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(906)
	19.04.2022	EUR	580.267	USD	646.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(238)
	19.04.2022	EUR	1.163.645	USD	1.295.926	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(477)
	19.04.2022	EUR	17.303	USD	19.270	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	CHF	30.103	USD	32.446	Absicherung	JP Morgan Chase New York	286
	19.04.2022	EUR	12.582	USD	14.053	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46)
	19.04.2022	EUR	26.484	USD	29.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(97)
	19.04.2022	EUR	57.568	USD	64.299	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(211)
	19.04.2022	EUR	282.854	USD	315.927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.035)
								<b>USD 1.874.184</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>	19.04.2022	EUR	361.175	USD	397.756	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.328
	19.04.2022	EUR	868.556	USD	956.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.408
	19.04.2022	EUR	543.774	USD	598.850	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.516
	19.04.2022	EUR	3.493	USD	3.837	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
	19.04.2022	EUR	28.164	USD	31.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	220
	19.04.2022	EUR	67.128	USD	74.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	523
	19.04.2022	EUR	42.076	USD	46.514	Absicherung	JP Morgan Chase New York	328
	19.04.2022	USD	674	EUR	613	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	12.206	USD	13.536	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
	19.04.2022	EUR	29.100	USD	32.271	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124
	19.04.2022	EUR	18.245	USD	20.234	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	USD	37.101	EUR	33.550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(249)
	19.04.2022	EUR	80.803	USD	89.759	Absicherung	JP Morgan Chase New York	197
	19.04.2022	USD	1.813	EUR	1.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
								<b>USD 22.574</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	19.04.2022	SGD	1.000	USD	738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	SGD	8.265	USD	6.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	SGD	56	USD	41	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	99	USD	73	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	13.071	USD	9.651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	SGD	139	USD	103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	1.183	USD	875	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	4.883.787	USD	3.574.226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34.111
	19.04.2022	SGD	621.027	USD	454.502	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.338
	19.04.2022	SGD	569.836	USD	417.038	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.980
	19.04.2022	AUD	86.830	USD	62.470	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.750
	19.04.2022	EUR	50.144	USD	55.223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	601
	19.04.2022	EUR	787	USD	867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	SGD	992	USD	727	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	SGD	1.190	USD	871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	SGD	117.448	USD	86.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	153
	19.04.2022	SGD	14.929	USD	11.011	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	SGD	13.698	USD	10.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	AUD	2.076	USD	1.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	19.04.2022	EUR	1.213	USD	1.341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	1.000	USD	739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	105.454	USD	77.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	130
	19.04.2022	SGD	13.408	USD	9.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.04.2022	SGD	12.299	USD	9.072	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2022	AUD	1.831	USD	1.355	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20
	19.04.2022	EUR	1.074	USD	1.189	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	17	USD	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 46.258</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>								
	19.04.2022	CHF	814	EUR	788	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	GBP	3.292.514	EUR	3.893.641	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(115)
	19.04.2022	CHF	30.987.820	EUR	30.013.695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	252.754
	19.04.2022	GBP	646	EUR	764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	31.546	GBP	26.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	114
	19.04.2022	EUR	2.672	GBP	2.246	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2022	CHF	39	EUR	38	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	GBP	156.281	EUR	186.213	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.405)
	19.04.2022	CHF	1.491.383	EUR	1.435.468	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.195
	19.04.2022	GBP	31	EUR	37	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	11.565	EUR	13.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(86)
	19.04.2022	EUR	2.552	GBP	2.157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	GBP	20.100	EUR	23.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(166)
	19.04.2022	CHF	27	EUR	26	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	106.307	EUR	126.475	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(763)
	19.04.2022	CHF	1.008.006	EUR	977.350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.190
	19.04.2022	GBP	21	EUR	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	529	GBP	443	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	CHF	1.609.750	EUR	1.565.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.879
	19.04.2022	GBP	2.179	EUR	2.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2022	GBP	91.396	EUR	109.672	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.592)
	19.04.2022	GBP	172	EUR	206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	GBP	11.000	EUR	13.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(194)
	19.04.2022	GBP	703	EUR	838	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	GBP	25	EUR	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	5.245	EUR	6.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
								<b>EUR 283.806</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
	19.04.2022	EUR	27.015.330	USD	29.751.577	Absicherung	JP Morgan Chase New York	323.725
	19.04.2022	EUR	22.081.907	USD	24.318.473	Absicherung	JP Morgan Chase New York	264.608
	19.04.2022	EUR	2.615.169	USD	2.880.046	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31.338
	19.04.2022	EUR	661.970	USD	729.017	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.932
	19.04.2022	EUR	804	USD	886	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	66.746	USD	73.370	Absicherung	JP Morgan Chase New York	936
	19.04.2022	EUR	461.143	USD	506.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.467
	19.04.2022	USD	1.937	EUR	1.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(25)
	19.04.2022	EUR	62.341	USD	68.485	Absicherung	JP Morgan Chase New York	917
	19.04.2022	EUR	1.955	USD	2.148	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.04.2022	EUR	116.752	USD	128.260	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.717
	19.04.2022	EUR	243	USD	267	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	4.151.513	USD	4.589.384	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32.362
	19.04.2022	EUR	102.018	USD	112.778	Absicherung	JP Morgan Chase New York	795
	19.04.2022	EUR	1.233.632	USD	1.363.746	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.617
	19.04.2022	EUR	994.024	USD	1.098.866	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.749
	19.04.2022	EUR	117.303	USD	129.675	Absicherung	JP Morgan Chase New York	914
	19.04.2022	EUR	29.720	USD	32.855	Absicherung	JP Morgan Chase New York	232

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	36	USD	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	300.802	USD	330.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.882
	19.04.2022	USD	6.527	EUR	5.932	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(77)
	19.04.2022	USD	198	EUR	180	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	106.812	USD	117.531	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.378
	19.04.2022	EUR	181.516	USD	201.836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	240
	19.04.2022	EUR	1.723	USD	1.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	512.735	USD	570.134	Absicherung	JP Morgan Chase New York	677
	19.04.2022	EUR	184.631	USD	204.161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.383
	19.04.2022	USD	6.433	EUR	5.818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2022	EUR	40.972	USD	45.306	Absicherung	JP Morgan Chase New York	307
	19.04.2022	EUR	2.323.323	USD	2.570.654	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.827
	19.04.2022	EUR	56.673	USD	62.706	Absicherung	JP Morgan Chase New York	386
	19.04.2022	EUR	688.055	USD	761.302	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.687
	19.04.2022	EUR	564.548	USD	624.647	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.846
	19.04.2022	EUR	65.369	USD	72.328	Absicherung	JP Morgan Chase New York	445
	19.04.2022	EUR	16.576	USD	18.341	Absicherung	JP Morgan Chase New York	113
	19.04.2022	EUR	20	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	271.345	USD	300.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.017
	19.04.2022	EUR	1.060	USD	1.172	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	EUR	6.518	USD	7.207	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	19.04.2022	EUR	4.704	USD	5.202	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.04.2022	EUR	23.053	USD	25.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	235
	19.04.2022	USD	602	EUR	545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	107.971	USD	118.867	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.334
	19.04.2022	EUR	909.405	USD	1.001.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.237
	19.04.2022	EUR	4.106	USD	4.520	Absicherung	JP Morgan Chase New York	51
	19.04.2022	USD	123.490	EUR	112.111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.319)
	19.04.2022	EUR	350	USD	386	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	USD	2.920	EUR	2.651	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2022	EUR	6.412	USD	7.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	19.04.2022	EUR	92.473.535	USD	101.839.717	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.108.110
	19.04.2022	EUR	2.275.867	USD	2.506.378	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27.272
	19.04.2022	EUR	1.291.324	USD	1.419.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18.208
	19.04.2022	EUR	656	USD	721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	USD	3.980	EUR	3.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(51)
	19.04.2022	EUR	13.003	USD	14.292	Absicherung	JP Morgan Chase New York	183
	19.04.2022	EUR	131.648	USD	144.496	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.063
	19.04.2022	EUR	326	USD	358	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	USD	20.736	EUR	18.892	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(296)
	19.04.2022	USD	1.644	EUR	1.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(23)
	19.04.2022	EUR	121.592	USD	135.069	Absicherung	JP Morgan Chase New York	296
	19.04.2022	EUR	98	USD	109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	1.799.048	USD	1.998.444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.381
	19.04.2022	EUR	2.603.261	USD	2.899.195	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.068)
	19.04.2022	EUR	62.322	USD	69.406	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2022	EUR	799.748	USD	890.662	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(328)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	635.129	USD	707.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(261)
	19.04.2022	EUR	72.683	USD	80.945	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2022	EUR	18.448	USD	20.545	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	22	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	20.682	USD	23.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(76)
	19.04.2022	EUR	1.651	USD	1.844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	943	USD	1.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	1.011	USD	1.129	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
								<b>USD 1.894.412</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
	19.04.2022	EUR	735.990	USD	810.535	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.819
	19.04.2022	EUR	317.008	USD	349.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.799
	19.04.2022	EUR	541.336	USD	596.165	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.487
	19.04.2022	EUR	769	USD	846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	324.992	USD	357.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.894
	19.04.2022	EUR	10.676	USD	11.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	128
	19.04.2022	EUR	17.179	USD	18.919	Absicherung	JP Morgan Chase New York	206
	19.04.2022	EUR	5.075	USD	5.575	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75
	19.04.2022	USD	2.956	EUR	2.691	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.04.2022	EUR	36.543	USD	40.398	Absicherung	JP Morgan Chase New York	285
	19.04.2022	EUR	15.584	USD	17.227	Absicherung	JP Morgan Chase New York	121
	19.04.2022	EUR	26.793	USD	29.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	209
	19.04.2022	EUR	38	USD	42	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	16.073	USD	17.768	Absicherung	JP Morgan Chase New York	125
	19.04.2022	EUR	528	USD	584	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	850	USD	940	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	19.725	USD	21.825	Absicherung	JP Morgan Chase New York	134
	19.04.2022	EUR	8.354	USD	9.244	Absicherung	JP Morgan Chase New York	57
	19.04.2022	EUR	14.436	USD	15.973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	98
	19.04.2022	EUR	20	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	8.654	USD	9.575	Absicherung	JP Morgan Chase New York	59
	19.04.2022	EUR	285	USD	315	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	458	USD	507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	USD	51	EUR	47	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	690	USD	761	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	949	USD	1.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2022	USD	5	EUR	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	5	USD	5	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	1.105	EUR	995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	19.524	USD	21.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	8.205	USD	9.138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	14.407	USD	16.045	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	20	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	8.626	USD	9.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	EUR	284	USD	316	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	457	USD	509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	828	EUR	741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
								<b>USD 24.480</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>								
	19.04.2022	EUR	2.190.941	USD	2.412.850	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26.254
	19.04.2022	EUR	395.409	USD	435.458	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.738
	19.04.2022	EUR	9.207.395	USD	10.139.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110.331
	19.04.2022	EUR	568.485	USD	626.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.812
	19.04.2022	EUR	24.542	USD	26.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	344
	19.04.2022	EUR	87.300	USD	96.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	681
	19.04.2022	EUR	15.744	USD	17.405	Absicherung	JP Morgan Chase New York	123
	19.04.2022	EUR	368.307	USD	407.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.871
	19.04.2022	EUR	22.680	USD	25.073	Absicherung	JP Morgan Chase New York	177
	19.04.2022	USD	65	EUR	59	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	10.134	USD	11.206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
	19.04.2022	USD	10.036	EUR	9.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(113)
	19.04.2022	EUR	72.000	USD	79.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	848
	19.04.2022	EUR	51.313	USD	56.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	871
	19.04.2022	EUR	9.200	USD	10.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	156
	19.04.2022	EUR	218.238	USD	239.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.703
	19.04.2022	EUR	13.439	USD	14.733	Absicherung	JP Morgan Chase New York	228
	19.04.2022	EUR	11.553	USD	12.834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	28
	19.04.2022	USD	1.681	EUR	1.505	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	EUR	29.548	USD	33.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(108)
								<b>USD 158.026</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>								
	19.04.2022	USD	1.509	SGD	2.047	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	SGD	1.000	USD	738	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	116	SGD	157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	19.419	USD	14.322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2022	SGD	44	USD	32	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	28	USD	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	22.254	USD	16.427	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
	19.04.2022	SGD	50	USD	37	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	31	USD	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	3.000	USD	2.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	SGD	444.498	USD	325.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.104
	19.04.2022	SGD	1.000	USD	732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	631	USD	695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	SGD	450	USD	329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
								<b>USD 3.161</b>



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>								
	19.04.2022	EUR	626	USD	689	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	624	USD	687	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	26	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	26	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	25	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	25	USD	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 16</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
	19.04.2022	EUR	618.844	USD	681.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.416
	19.04.2022	EUR	6.337.884	USD	6.979.817	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75.947
	19.04.2022	CHF	883	USD	942	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	GBP	686	USD	893	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	5.947	USD	6.549	Absicherung	JP Morgan Chase New York	71
	19.04.2022	SGD	134.390.381	USD	98.354.336	Absicherung	JP Morgan Chase New York	938.653
	19.04.2022	USD	2.031	EUR	1.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2022	EUR	12.091	USD	13.282	Absicherung	JP Morgan Chase New York	178
	19.04.2022	EUR	13.562	USD	14.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	216
	19.04.2022	EUR	138.990	USD	152.515	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.218
	19.04.2022	CHF	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	15	USD	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	130	USD	143	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	SGD	2.923.352	USD	2.145.999	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.890
	19.04.2022	EUR	14.813	USD	16.375	Absicherung	JP Morgan Chase New York	115
	19.04.2022	EUR	152.087	USD	168.128	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.186
	19.04.2022	CHF	21	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	GBP	16	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	142	USD	157	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	SGD	3.211.295	USD	2.368.462	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.171
	19.04.2022	EUR	716	USD	797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	3.859	EUR	3.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2022	EUR	15.101	USD	16.708	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103
	19.04.2022	EUR	155.188	USD	171.709	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.057
	19.04.2022	CHF	22	USD	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	17	USD	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	145	USD	161	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	SGD	3.308.422	USD	2.440.324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.070
	19.04.2022	EUR	7.628	USD	8.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	USD	453	EUR	412	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	EUR	2.957	USD	3.258	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.04.2022	USD	1.842	EUR	1.676	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(24)
	19.04.2022	EUR	6.203	USD	6.808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	19.04.2022	EUR	16.112	USD	17.745	Absicherung	JP Morgan Chase New York	192
	19.04.2022	EUR	166.769	USD	183.676	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.983
	19.04.2022	CHF	23	USD	25	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	18	USD	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	3.606.885	USD	2.652.263	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.651
	19.04.2022	EUR	898	USD	998	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	3.462	USD	3.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
(Fortsetzung)	19.04.2022	EUR	185	USD	206	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	4.024	USD	4.495	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
								<b>USD 1.064.274</b>
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>								
	19.04.2022	EUR	831	USD	916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	300.227	USD	330.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.598
	19.04.2022	EUR	844	USD	930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	CHF	912	USD	973	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	EUR	841	USD	927	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	CHF	923	USD	984	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	EUR	831	USD	915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	35	USD	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	12.645	USD	13.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	99
	19.04.2022	EUR	36	USD	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	39	USD	41	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	35	USD	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	39	USD	41	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	35	USD	39	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	6.420	USD	7.103	Absicherung	JP Morgan Chase New York	44
	19.04.2022	EUR	18	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	20	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	20	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	USD	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	100.455	USD	110.592	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.242
	19.04.2022	EUR	204.173	USD	224.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.200
	19.04.2022	EUR	27	USD	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	15.993	USD	17.811	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	EUR	28	USD	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	30	USD	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	28	USD	31	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	31	USD	33	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	19	USD	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 8.256</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>								
	19.04.2022	USD	1.162	EUR	1.054	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	USD	6.270	EUR	5.688	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(56)
	19.04.2022	SGD	29.698	EUR	19.869	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(159)
	19.04.2022	SGD	4.209	EUR	2.815	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(21)
	19.04.2022	SGD	1.545	EUR	1.035	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	EUR	994	SGD	1.485	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	SGD	69.561	EUR	46.182	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.04.2022	SGD	9.914	EUR	6.562	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	SGD	8.144.155	EUR	5.414.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.604)
	19.04.2022	USD	41.931	EUR	38.075	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(410)
	19.04.2022	USD	225.356	EUR	204.630	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.203)
	19.04.2022	SGD	9.225	EUR	6.153	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2022	USD	1.500	EUR	1.365	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.04.2022	SGD	139.939	EUR	93.243	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(370)
	19.04.2022	SGD	297.730	EUR	198.700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.106)
	19.04.2022	USD	1.513	EUR	1.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	USD	8.176	EUR	7.396	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(52)
	19.04.2022	SGD	60.037	EUR	40.101	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(256)
	19.04.2022	SGD	11.604	EUR	7.707	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	236.241	SGD	354.301	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.104
	19.04.2022	EUR	63.764	SGD	95.566	Absicherung	JP Morgan Chase New York	341
	19.04.2022	USD	1.000	EUR	904	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	4.277	SGD	6.406	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26
	19.04.2022	SGD	225.252	EUR	150.474	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(981)
								<b>EUR (13.825)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>								
	19.04.2022	SGD	16.497.900	EUR	10.968.576	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19.451)
	19.04.2022	CHF	17.755	EUR	17.197	Absicherung	JP Morgan Chase New York	145
	19.04.2022	USD	415.760	EUR	377.523	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.064)
	19.04.2022	USD	13.743	EUR	12.479	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(134)
	19.04.2022	EUR	41.869	SGD	62.775	Absicherung	JP Morgan Chase New York	207
	19.04.2022	SGD	11.406	EUR	7.600	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2022	CHF	5.821	EUR	5.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	19.04.2022	SGD	564.624	EUR	376.820	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.098)
	19.04.2022	CHF	913	EUR	878	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	USD	14.339	EUR	12.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(91)
	19.04.2022	USD	473	EUR	428	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	1.225	SGD	1.834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	SGD	3.550	EUR	2.358	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	115.553	SGD	173.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	540
	19.04.2022	EUR	217.806	USD	240.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.468
	19.04.2022	USD	767	EUR	694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	SGD	379.150	EUR	252.831	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.201)
	19.04.2022	CHF	544	EUR	528	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	USD	9.641	EUR	8.714	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53)
	19.04.2022	USD	318	EUR	287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	32.660	SGD	48.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	174
	19.04.2022	SGD	14.935	EUR	9.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60)
	19.04.2022	EUR	14.339	SGD	21.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	115
	19.04.2022	CHF	8.194	EUR	7.991	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	EUR	4.647	SGD	6.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.04.2022	EUR	1.649	SGD	2.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b> <i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	SGD	17.811	EUR	11.921	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(100)
	19.04.2022	EUR	3.567	USD	3.915	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	19.04.2022	EUR	69.014	SGD	103.953	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	EUR	44.815	SGD	67.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(123)
								<b>EUR (24.556)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>	19.04.2022	CHF	3.021.211	EUR	2.926.237	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24.643
	19.04.2022	USD	24.265.328	EUR	22.033.650	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(237.166)
	19.04.2022	CHF	9.198.008	EUR	8.908.862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	75.024
	19.04.2022	USD	14.240.070	EUR	12.930.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(139.180)
	19.04.2022	CHF	227.401	EUR	220.252	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.855
	19.04.2022	USD	3.173.910	EUR	2.882.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31.021)
	19.04.2022	USD	25.000	EUR	22.743	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(286)
	19.04.2022	EUR	13.252	CHF	13.616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(47)
	19.04.2022	CHF	109.032	EUR	104.944	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.550
	19.04.2022	USD	875.108	EUR	791.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.543)
	19.04.2022	CHF	331.871	EUR	319.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.717
	19.04.2022	USD	513.672	EUR	464.662	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.254)
	19.04.2022	CHF	8.218	EUR	7.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	117
	19.04.2022	USD	114.497	EUR	103.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(725)
	19.04.2022	EUR	81.064	USD	89.200	Absicherung	JP Morgan Chase New York	940
	19.04.2022	EUR	12.618	CHF	13.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(184)
	19.04.2022	CHF	121.854	EUR	118.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	886
	19.04.2022	EUR	99.267	CHF	102.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(744)
	19.04.2022	CHF	69.526	EUR	67.411	Absicherung	JP Morgan Chase New York	496
	19.04.2022	USD	567.541	EUR	512.936	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.139)
	19.04.2022	CHF	212.489	EUR	206.027	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.516
	19.04.2022	USD	331.423	EUR	299.536	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.833)
	19.04.2022	CHF	5.262	EUR	5.102	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	19.04.2022	USD	74.317	EUR	67.166	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(411)
	19.04.2022	CHF	15.216	EUR	14.797	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.04.2022	EUR	48.997	USD	54.047	Absicherung	JP Morgan Chase New York	449
	19.04.2022	USD	54.000	EUR	48.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(449)
	19.04.2022	EUR	167.902	USD	184.845	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.865
	19.04.2022	EUR	62.024	CHF	63.603	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(98)
	19.04.2022	EUR	28.788	USD	31.694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	320
	19.04.2022	EUR	38.381	USD	42.276	Absicherung	JP Morgan Chase New York	406
	19.04.2022	EUR	47.211	CHF	48.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.04.2022	EUR	62.648	USD	69.007	Absicherung	JP Morgan Chase New York	663
	19.04.2022	EUR	71.421	CHF	73.152	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.04.2022	EUR	509.043	USD	558.064	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7.762
	19.04.2022	EUR	205.216	CHF	210.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(81)
	19.04.2022	EUR	297.553	USD	326.208	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.536
	19.04.2022	EUR	5.162	CHF	5.288	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b> (Fortsetzung)								
	19.04.2022	EUR	66.630	USD	73.047	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.016
	19.04.2022	CHF	1.698	EUR	1.655	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	CHF	148.548	EUR	144.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	280
	19.04.2022	EUR	23.177	CHF	23.966	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(231)
	19.04.2022	CHF	114.813	EUR	111.196	Absicherung	JP Morgan Chase New York	945
	19.04.2022	USD	894.321	EUR	803.034	Absicherung	JP Morgan Chase New York	296
	19.04.2022	CHF	335.659	EUR	325.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.761
	19.04.2022	USD	526.679	EUR	472.919	Absicherung	JP Morgan Chase New York	174
	19.04.2022	CHF	8.380	EUR	8.116	Absicherung	JP Morgan Chase New York	69
	19.04.2022	USD	118.498	EUR	106.402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.04.2022	EUR	63.326	CHF	65.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(359)
	19.04.2022	EUR	70.296	USD	78.516	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(231)
								<b>EUR (291.620)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
	19.04.2022	USD	407.394	EUR	369.926	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.982)
	19.04.2022	USD	890	EUR	808	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	GBP	115.392	EUR	136.460	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	GBP	7.782.339	EUR	9.203.193	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(273)
	19.04.2022	SGD	34.136.562	EUR	22.695.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40.247)
	19.04.2022	USD	4.764.429	EUR	4.326.245	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(46.567)
	19.04.2022	EUR	51.650	GBP	43.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	187
	19.04.2022	EUR	13.082	GBP	11.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	74
	19.04.2022	EUR	149	SGD	223	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	15.402	EUR	13.933	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(98)
	19.04.2022	USD	34	EUR	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	4.356	EUR	5.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(39)
	19.04.2022	GBP	292.019	EUR	347.949	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.626)
	19.04.2022	SGD	1.285.456	EUR	857.891	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.775)
	19.04.2022	USD	180.168	EUR	162.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.141)
	19.04.2022	GBP	14	EUR	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	2.810	EUR	1.877	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2022	SGD	2.500	EUR	1.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	GBP	2.471	EUR	2.942	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.04.2022	SGD	10.000	EUR	6.668	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2022	USD	9.939	EUR	8.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(55)
	19.04.2022	USD	22	EUR	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	2.780	EUR	3.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.04.2022	GBP	186.536	EUR	221.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.338)
	19.04.2022	SGD	827.370	EUR	551.721	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.621)
	19.04.2022	USD	116.280	EUR	105.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(643)
	19.04.2022	EUR	96.507	GBP	80.834	Absicherung	JP Morgan Chase New York	919
	19.04.2022	EUR	3.564	SGD	5.342	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	EUR	7.357	GBP	6.121	Absicherung	JP Morgan Chase New York	119
	19.04.2022	SGD	992	EUR	662	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	EUR	8.550	GBP	7.125	Absicherung	JP Morgan Chase New York	124

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	SGD	6.100	EUR	4.081	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(33)
	19.04.2022	SGD	51.590	EUR	34.498	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(259)
	19.04.2022	GBP	34.999	EUR	42.004	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(617)
	19.04.2022	EUR	70.719	SGD	105.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	646
	19.04.2022	EUR	4	GBP	3	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	99	EUR	66	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	EUR	2.304	USD	2.528	Absicherung	JP Morgan Chase New York	32
	19.04.2022	EUR	5.205	GBP	4.402	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	GBP	4.214	EUR	4.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	EUR	89.213	SGD	134.792	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(244)
								<b>EUR (103.527)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>								
	19.04.2022	CHF	366.608	EUR	355.084	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.990
	19.04.2022	CHF	10.204.410	EUR	9.883.627	Absicherung	JP Morgan Chase New York	83.233
	19.04.2022	CHF	1.392	EUR	1.348	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2022	CHF	12.936	EUR	12.451	Absicherung	JP Morgan Chase New York	184
	19.04.2022	CHF	360.536	EUR	347.019	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5.124
	19.04.2022	CHF	49	EUR	47	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	CHF	8.919	EUR	8.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	94
	19.04.2022	CHF	820	EUR	793	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	365.395	CHF	379.544	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5.314)
	19.04.2022	EUR	25.031	CHF	26.000	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(364)
	19.04.2022	CHF	40.715	EUR	39.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	296
	19.04.2022	CHF	244.226	EUR	236.799	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.743
	19.04.2022	CHF	33	EUR	32	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	79.767	EUR	77.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	296
	19.04.2022	CHF	19	EUR	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	CHF	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	29	EUR	28	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	38.354	CHF	39.491	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(218)
								<b>EUR 88.083</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>								
	19.04.2022	EUR	62.487	USD	69.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	487
	19.04.2022	EUR	29.386	USD	32.485	Absicherung	JP Morgan Chase New York	229
	19.04.2022	GBP	4.688	USD	6.175	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	EUR	82.280	USD	91.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	352
	19.04.2022	EUR	38.660	USD	42.873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	165
	19.04.2022	GBP	6.241	USD	8.211	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	EUR	7.000	USD	7.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	987	USD	1.092	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	96	USD	107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	4.000	USD	4.404	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49
	19.04.2022	EUR	13.289	USD	14.638	Absicherung	JP Morgan Chase New York	156
	19.04.2022	EUR	3.500	USD	3.847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	49

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b> (Fortsetzung)								
	19.04.2022	USD	10.222	EUR	9.313	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(146)
	19.04.2022	EUR	10.000	USD	11.108	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	USD	6.717	EUR	6.014	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	EUR	2.252.984	USD	2.481.178	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26.999
	19.04.2022	EUR	1.052.936	USD	1.159.583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12.618
	19.04.2022	GBP	169.494	USD	220.807	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.329
	19.04.2022	EUR	4.988	USD	5.482	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
								<b>USD 43.422</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
	19.04.2022	EUR	1.205.109	USD	1.327.168	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.441
	19.04.2022	USD	340.968	EUR	309.869	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.997)
	19.04.2022	EUR	199	USD	221	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	73.513	USD	81.742	Absicherung	JP Morgan Chase New York	97
	19.04.2022	EUR	93.270	USD	103.711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	123
	19.04.2022	EUR	2.385	USD	2.637	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18
	19.04.2022	EUR	48.435	USD	53.591	Absicherung	JP Morgan Chase New York	330
	19.04.2022	EUR	1.503.812	USD	1.663.901	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10.244
	19.04.2022	EUR	1.259.386	USD	1.393.455	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8.579
	19.04.2022	EUR	51.873	USD	57.395	Absicherung	JP Morgan Chase New York	353
	19.04.2022	CHF	44.523	USD	47.752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	660
	19.04.2022	EUR	401	USD	444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	USD	89.227	EUR	80.688	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(599)
	19.04.2022	EUR	423	USD	467	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	20.321	USD	22.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	207
	19.04.2022	EUR	1.764.616	USD	1.946.486	Absicherung	JP Morgan Chase New York	18.004
	19.04.2022	EUR	17.977	USD	19.791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	222
	19.04.2022	USD	102.149	EUR	92.737	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.091)
	19.04.2022	EUR	23.074	USD	25.416	Absicherung	JP Morgan Chase New York	272
	19.04.2022	EUR	57.967	USD	63.716	Absicherung	JP Morgan Chase New York	817
	19.04.2022	EUR	37.449.034	USD	41.242.059	Absicherung	JP Morgan Chase New York	448.752
	19.04.2022	EUR	43.205.989	USD	47.582.107	Absicherung	JP Morgan Chase New York	517.737
	19.04.2022	EUR	1.280.054	USD	1.409.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15.339
	19.04.2022	CHF	1.100.580	USD	1.174.251	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22.467
	19.04.2022	USD	212.055	EUR	192.910	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.704)
	19.04.2022	USD	8.980	EUR	8.174	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(120)
	19.04.2022	EUR	151.556	USD	166.493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.229
	19.04.2022	USD	13.845.112	EUR	12.602.930	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(185.223)
	19.04.2022	EUR	40.822	USD	44.794	Absicherung	JP Morgan Chase New York	652
	19.04.2022	EUR	1.262.367	USD	1.385.204	Absicherung	JP Morgan Chase New York	20.148
	19.04.2022	EUR	1.465.036	USD	1.607.595	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23.383
	19.04.2022	EUR	43.401	USD	47.624	Absicherung	JP Morgan Chase New York	693
	19.04.2022	CHF	37.378	USD	39.779	Absicherung	JP Morgan Chase New York	864
	19.04.2022	EUR	45.739	USD	50.563	Absicherung	JP Morgan Chase New York	357
	19.04.2022	EUR	1.429.398	USD	1.580.160	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.143
	19.04.2022	EUR	1.184.309	USD	1.309.222	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.232
	19.04.2022	EUR	48.948	USD	54.111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	382

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	CHF	42.100	USD	44.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	993
	19.04.2022	EUR	269.847	USD	296.608	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.805
	19.04.2022	EUR	55.773	USD	61.217	Absicherung	JP Morgan Chase New York	874
	19.04.2022	EUR	36.707	USD	40.429	Absicherung	JP Morgan Chase New York	436
	19.04.2022	EUR	1.140.978	USD	1.256.650	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13.565
	19.04.2022	EUR	1.009.035	USD	1.111.331	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.995
	19.04.2022	EUR	39.682	USD	43.705	Absicherung	JP Morgan Chase New York	472
	19.04.2022	CHF	34.174	USD	36.616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	543
	19.04.2022	EUR	499	USD	554	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	27.303	USD	30.329	Absicherung	JP Morgan Chase New York	66
	19.04.2022	EUR	1.398	USD	1.553	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	USD	66.686	EUR	59.705	Absicherung	JP Morgan Chase New York	218
	19.04.2022	EUR	2.015	USD	2.251	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
								<b>USD 966.982</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
	19.04.2022	CHF	93.797	GBP	76.841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	631
	19.04.2022	EUR	8.026.922	GBP	6.787.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	201
	19.04.2022	EUR	5.885.469	GBP	4.976.829	Absicherung	JP Morgan Chase New York	148
	19.04.2022	USD	926.397	GBP	711.114	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.423)
	19.04.2022	EUR	4.651.762	GBP	3.933.590	Absicherung	JP Morgan Chase New York	117
	19.04.2022	CHF	38.646	GBP	31.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	260
	19.04.2022	EUR	1.067.305	GBP	902.527	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.04.2022	EUR	5.623.742	GBP	4.755.509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	141
	19.04.2022	CHF	77.861	GBP	63.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	524
	19.04.2022	USD	4.456.243	GBP	3.420.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(35.706)
	19.04.2022	EUR	35.992	GBP	30.435	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	CHF	62.233	GBP	50.983	Absicherung	JP Morgan Chase New York	419
	19.04.2022	USD	949	GBP	729	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	794	GBP	671	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	877	GBP	719	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	954	GBP	732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	793	GBP	671	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	877	GBP	718	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	954	GBP	732	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	204.252	GBP	172.097	Absicherung	JP Morgan Chase New York	626
	19.04.2022	EUR	7.112	GBP	5.992	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	GBP	3.034	EUR	3.601	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2022	EUR	43.243	GBP	36.435	Absicherung	JP Morgan Chase New York	133
	19.04.2022	GBP	3.614	USD	4.715	Absicherung	JP Morgan Chase New York	33
	19.04.2022	GBP	45.243	EUR	53.806	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(257)
	19.04.2022	EUR	4.731	GBP	3.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2022	CHF	2.209	GBP	1.784	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
	19.04.2022	EUR	193.768	GBP	162.621	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.236
	19.04.2022	EUR	136.885	GBP	114.882	Absicherung	JP Morgan Chase New York	874
	19.04.2022	USD	21.808	GBP	16.555	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	109.488	GBP	91.889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	699



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	CHF	912	GBP	736	Absicherung	JP Morgan Chase New York	17
	19.04.2022	EUR	25.018	GBP	20.997	Absicherung	JP Morgan Chase New York	160
	19.04.2022	EUR	133.384	GBP	111.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	851
	19.04.2022	CHF	1.838	GBP	1.484	Absicherung	JP Morgan Chase New York	34
	19.04.2022	USD	104.834	GBP	79.585	Absicherung	JP Morgan Chase New York	47
	19.04.2022	EUR	847	GBP	711	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	CHF	1.469	GBP	1.186	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.04.2022	USD	22	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	19	GBP	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	21	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	23	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	19	GBP	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	21	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	22	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	28.500	GBP	23.950	Absicherung	JP Morgan Chase New York	151
	19.04.2022	GBP	1.645	EUR	1.957	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	EUR	654	GBP	550	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	GBP	17.713	EUR	20.956	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	GBP	4.422	EUR	5.231	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	EUR	440	GBP	372	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	10.010	EUR	11.920	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(70)
	19.04.2022	EUR	54.440	GBP	45.718	Absicherung	JP Morgan Chase New York	319
	19.04.2022	GBP	4.893	EUR	5.826	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(34)
	19.04.2022	EUR	300	GBP	251	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	28.256	GBP	23.667	Absicherung	JP Morgan Chase New York	227
	19.04.2022	GBP	21.181	EUR	25.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(203)
	19.04.2022	GBP	12.094	EUR	14.535	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(198)
	19.04.2022	GBP	2.708	EUR	3.255	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(44)
	19.04.2022	EUR	33.934	GBP	28.279	Absicherung	JP Morgan Chase New York	417
	19.04.2022	EUR	14.177	GBP	11.815	Absicherung	JP Morgan Chase New York	174
	19.04.2022	EUR	17.424	GBP	14.521	Absicherung	JP Morgan Chase New York	214
	19.04.2022	GBP	15.015	EUR	17.971	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(181)
	19.04.2022	EUR	13.330	GBP	11.138	Absicherung	JP Morgan Chase New York	135
	19.04.2022	EUR	7.570	GBP	6.325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	76
	19.04.2022	GBP	4.511	EUR	5.414	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(67)
	19.04.2022	EUR	322	GBP	269	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	24.843	GBP	20.700	Absicherung	JP Morgan Chase New York	309
	19.04.2022	GBP	16.927	EUR	20.315	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(252)
	19.04.2022	EUR	8.000	GBP	6.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	54
	19.04.2022	EUR	9	GBP	7	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	3.231	EUR	3.851	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2022	EUR	7.400	GBP	6.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	GBP	59.209	EUR	70.006	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	62.381	GBP	52.760	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	CHF	2.112	GBP	1.736	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	EUR	187.286	GBP	158.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(470)
	19.04.2022	EUR	131.223	GBP	111.296	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(329)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	USD	21.911	GBP	16.697	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(53)
	19.04.2022	EUR	106.695	GBP	90.493	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(268)
	19.04.2022	CHF	881	GBP	724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	24.174	GBP	20.503	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
	19.04.2022	EUR	128.190	GBP	108.723	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(322)
	19.04.2022	CHF	1.780	GBP	1.463	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	USD	105.587	GBP	80.459	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(256)
	19.04.2022	EUR	819	GBP	694	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	CHF	1.424	GBP	1.170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	22	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	GBP	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	20	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	23	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	18	GBP	15	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	20	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	23	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	1.336	GBP	1.132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	GBP	1.455	EUR	1.716	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	GBP	1.957	EUR	2.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
								<b>GBP (36.841)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
	19.04.2022	EUR	1.808.830	GBP	1.529.570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.04.2022	EUR	51.529	GBP	43.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	2.779.432	GBP	2.350.324	Absicherung	JP Morgan Chase New York	70
	19.04.2022	CHF	115.711	GBP	94.793	Absicherung	JP Morgan Chase New York	778
	19.04.2022	USD	6.153.764	GBP	4.723.708	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(49.308)
	19.04.2022	SGD	1.314	GBP	739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	EUR	534.251	GBP	451.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	EUR	114.597	GBP	96.905	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	EUR	299.928	GBP	253.623	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	USD	1.565.049	GBP	1.201.351	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12.540)
	19.04.2022	USD	1.007	GBP	773	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(8)
	19.04.2022	EUR	2.425.712	GBP	2.051.214	Absicherung	JP Morgan Chase New York	61
	19.04.2022	CHF	323.779	GBP	265.248	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.178
	19.04.2022	USD	1.148.327	GBP	881.470	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9.201)
	19.04.2022	CHF	457.055	GBP	374.431	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.075
	19.04.2022	CHF	918	GBP	752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	USD	3.256.918	GBP	2.500.052	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26.097)
	19.04.2022	EUR	1.546.665	GBP	1.307.880	Absicherung	JP Morgan Chase New York	39
	19.04.2022	USD	26.434	GBP	20.291	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(212)
	19.04.2022	EUR	482.016	GBP	407.599	Absicherung	JP Morgan Chase New York	12
	19.04.2022	EUR	189.511	GBP	159.350	Absicherung	JP Morgan Chase New York	907
	19.04.2022	GBP	166.842	EUR	198.537	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.048)
	19.04.2022	EUR	44.902	GBP	37.838	Absicherung	JP Morgan Chase New York	133
	19.04.2022	EUR	1.276	GBP	1.075	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	EUR	69.216	GBP	58.326	Absicherung	JP Morgan Chase New York	205

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	CHF	2.907	GBP	2.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	38
	19.04.2022	USD	155.370	GBP	118.098	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(79)
	19.04.2022	SGD	33	GBP	18	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	17.941	GBP	15.118	Absicherung	JP Morgan Chase New York	53
	19.04.2022	EUR	2.838	GBP	2.391	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	EUR	7.464	GBP	6.290	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	USD	39.612	GBP	30.109	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20)
	19.04.2022	USD	26	GBP	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	60.249	GBP	50.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	179
	19.04.2022	CHF	8.117	GBP	6.598	Absicherung	JP Morgan Chase New York	106
	19.04.2022	USD	29.008	GBP	22.049	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.04.2022	CHF	11.487	GBP	9.338	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150
	19.04.2022	CHF	23	GBP	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	82.482	GBP	62.695	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2022	EUR	37.031	GBP	31.205	Absicherung	JP Morgan Chase New York	110
	19.04.2022	USD	670	GBP	509	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	12.004	GBP	10.115	Absicherung	JP Morgan Chase New York	36
	19.04.2022	USD	1.072	GBP	809	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	GBP	27.126	EUR	32.465	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(327)
	19.04.2022	GBP	150.501	EUR	180.122	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.816)
	19.04.2022	EUR	99.996	GBP	83.318	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.243
	19.04.2022	EUR	1.024	GBP	866	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	58.791	GBP	49.864	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(147)
	19.04.2022	CHF	2.447	GBP	2.011	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	6.324	GBP	5.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16)
	19.04.2022	USD	34.001	GBP	25.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(82)
	19.04.2022	USD	22	GBP	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	6.783	GBP	5.573	Absicherung	JP Morgan Chase New York	29
	19.04.2022	USD	24.732	GBP	18.846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(60)
	19.04.2022	CHF	9.694	GBP	7.965	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
	19.04.2022	CHF	19	GBP	16	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	70.948	GBP	54.063	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(171)
	19.04.2022	EUR	25.247	GBP	21.413	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(63)
	19.04.2022	USD	576	GBP	439	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	EUR	10.197	GBP	8.649	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(26)
	19.04.2022	EUR	200	GBP	170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>GBP (91.711)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
	19.04.2022	EUR	784.329	USD	863.770	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9.399
	19.04.2022	CHF	10.822	USD	11.547	Absicherung	JP Morgan Chase New York	221
	19.04.2022	GBP	19.960	USD	26.003	Absicherung	JP Morgan Chase New York	274
	19.04.2022	EUR	73.796	USD	81.271	Absicherung	JP Morgan Chase New York	884
	19.04.2022	EUR	2.552.407	USD	2.810.928	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30.586
	19.04.2022	GBP	1.901.156	USD	2.476.712	Absicherung	JP Morgan Chase New York	26.126
	19.04.2022	GBP	10.971.443	USD	14.292.938	Absicherung	JP Morgan Chase New York	150.769

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	GBP	29.984	USD	39.061	Absicherung	JP Morgan Chase New York	412
	19.04.2022	EUR	824	USD	907	Absicherung	JP Morgan Chase New York	10
	19.04.2022	EUR	17.015	USD	18.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	239
	19.04.2022	EUR	2.804	USD	3.080	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
	19.04.2022	EUR	1.975	USD	2.173	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2022	USD	5.723	EUR	5.147	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7)
	19.04.2022	EUR	32.270	USD	35.683	Absicherung	JP Morgan Chase New York	242
	19.04.2022	USD	28.786	EUR	26.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(193)
	19.04.2022	EUR	4.087	USD	4.519	Absicherung	JP Morgan Chase New York	30
	19.04.2022	USD	88.317	EUR	80.065	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(816)
	19.04.2022	GBP	492	USD	652	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	EUR	565	USD	622	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	EUR	4.243	USD	4.674	Absicherung	JP Morgan Chase New York	50
	19.04.2022	EUR	7.178	USD	7.890	Absicherung	JP Morgan Chase New York	101
	19.04.2022	EUR	7.220	USD	7.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	113
	19.04.2022	GBP	16.685	USD	21.829	Absicherung	JP Morgan Chase New York	137
	19.04.2022	EUR	14.399	USD	15.995	Absicherung	JP Morgan Chase New York	35
	19.04.2022	EUR	15.902	USD	17.762	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(58)
								<b>USD 218.622</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
	19.04.2022	USD	2.114.701	EUR	1.920.212	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(20.669)
	19.04.2022	GBP	349.716	EUR	413.565	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(12)
	19.04.2022	GBP	9.391.745	EUR	11.106.434	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(329)
	19.04.2022	GBP	2.547.247	EUR	3.012.308	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(89)
	19.04.2022	GBP	1.753.207	EUR	2.073.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
	19.04.2022	GBP	715	EUR	846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	91.064	EUR	107.690	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	3.612	GBP	3.044	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	EUR	17	GBP	14	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	8.520	GBP	7.164	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48
	19.04.2022	EUR	13.747	GBP	11.559	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	GBP	444	EUR	528	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	EUR	12.560	GBP	10.616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6
	19.04.2022	GBP	3.657	EUR	4.354	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(30)
	19.04.2022	GBP	542	EUR	647	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	22	GBP	19	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	3.433	GBP	2.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	55
	19.04.2022	EUR	48	GBP	40	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	GBP	9.725	EUR	11.670	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(169)
	19.04.2022	EUR	7	GBP	6	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	36.391	USD	40.085	Absicherung	JP Morgan Chase New York	385
	19.04.2022	GBP	2.206	EUR	2.640	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(31)
	19.04.2022	GBP	408	EUR	488	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	14.057	GBP	11.718	Absicherung	JP Morgan Chase New York	200
	19.04.2022	EUR	28	GBP	23	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b> (Fortsetzung)								
	19.04.2022	GBP	364	EUR	437	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	GBP	793	EUR	952	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	EUR	2	GBP	1	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	28.521	GBP	23.928	Absicherung	JP Morgan Chase New York	226
	19.04.2022	GBP	67	EUR	79	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	EUR	18.781	USD	20.862	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41
	19.04.2022	EUR	132	GBP	111	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	527	GBP	446	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	07.04.2022	EUR	686.443	GBP	576.336	Handel	Lloyds	4.613
	07.04.2022	EUR	8.146.868	USD	9.000.000	Handel	Lloyds	59.638
	07.04.2022	USD	517.260	EUR	471.229	Handel	Lloyds	(6.429)
	07.04.2022	GBP	6.213.650	EUR	7.397.000	Handel	Lloyds	(45.972)
	07.04.2022	USD	1.163.230	EUR	1.056.500	Handel	Lloyds	(11.242)
	07.04.2022	EUR	685.140	USD	756.469	Handel	Barclays	5.391
	07.04.2022	EUR	743.555	GBP	624.879	Handel	Barclays	4.295
	07.04.2022	USD	2.000.000	EUR	1.805.726	Handel	Royal Bank of Scotland	(8.561)
	07.04.2022	EUR	455.117	USD	502.197	Handel	Barclays	3.853
	07.04.2022	USD	475.764	EUR	432.230	Handel	Royal Bank of Scotland	(4.717)
	07.04.2022	EUR	2.271.267	USD	2.500.000	Handel	Lloyds	24.816
	07.04.2022	EUR	619.947	GBP	516.501	Handel	Barclays	8.905
	07.04.2022	USD	7.296.180	EUR	6.627.946	Handel	Barclays	(71.728)
	07.04.2022	EUR	599.276	USD	657.820	Handel	Lloyds	8.172
	07.04.2022	GBP	3.869.480	EUR	4.584.816	Handel	Barclays	(7.047)
	07.04.2022	USD	1.231.521	EUR	1.115.177	Handel	Barclays	(8.555)
	07.04.2022	EUR	955.113	GBP	810.677	Handel	Barclays	(3.955)
	07.04.2022	EUR	1.105.147	USD	1.231.915	Handel	Royal Bank of Scotland	(1.831)
	07.04.2022	USD	394.690	EUR	355.644	Handel	Lloyds	(982)
	07.04.2022	USD	1.000.000	EUR	902.064	Handel	Lloyds	(3.481)
	07.04.2022	EUR	158.781.140	USD	176.280.378	Handel	JP Morgan Chase New York	378.769
	07.04.2022	EUR	231.982.624	GBP	192.510.711	Handel	JP Morgan Chase New York	4.234.866
	07.04.2022	GBP	969.798	EUR	1.176.736	Handel	Lloyds	(29.422)
	07.04.2022	GBP	780.380	EUR	939.504	Handel	Goldman Sachs	(16.280)
	07.04.2022	USD	1.213.431	EUR	1.113.076	Handel	Royal Bank of Scotland	(22.708)
	07.04.2022	EUR	3.182.808	USD	3.500.000	Handel	Lloyds	37.776
								<b>EUR 4.507.807</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>								
	19.04.2022	CHF	902	EUR	873	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	USD	977	EUR	887	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	GBP	711	EUR	841	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	979	EUR	889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	GBP	712	EUR	842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	986	EUR	895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	GBP	717	EUR	848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	979	EUR	889	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b> (Fortsetzung)								
	19.04.2022	CHF	898	EUR	870	Absicherung	JP Morgan Chase New York	7
	19.04.2022	GBP	707	EUR	836	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	984	EUR	894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	GBP	716	EUR	846	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SEK	8.339	EUR	791	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	NOK	8.387	EUR	842	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	NOK	8.435	EUR	847	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	GBP	34.726.539	EUR	41.066.704	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.218)
	19.04.2022	USD	986	EUR	895	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(10)
	19.04.2022	EUR	3.065.840	GBP	2.583.191	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.124
	01.04.2022	USD	90.286	EUR	82.847	Handel	Citigroup Global Markets	(1.702)
	01.04.2022	EUR	362.124	USD	400.000	Handel	JP Morgan Chase New York	2.622
	01.04.2022	EUR	9.720.524	USD	10.920.599	Handel	Barclays	(94.420)
	01.04.2022	EUR	13.492.403	GBP	11.315.634	Handel	Barclays	102.093
	01.04.2022	GBP	1.032.720	EUR	1.238.192	Handel	JP Morgan Chase New York	(16.126)
	01.04.2022	USD	70.111	EUR	63.104	Handel	Citigroup Global Markets	(92)
	01.04.2022	GBP	250.000	EUR	303.786	Handel	JP Morgan Chase New York	(7.950)
	01.04.2022	GBP	52.634	EUR	63.874	Handel	Barclays	(1.590)
	01.04.2022	USD	300.000	EUR	273.026	Handel	JP Morgan Chase New York	(3.400)
	01.04.2022	GBP	250.000	EUR	297.015	Handel	Barclays	(1.178)
	01.04.2022	GBP	500.000	EUR	595.283	Handel	Barclays	(3.610)
	01.04.2022	EUR	68.679	USD	75.769	Handel	Barclays	581
	01.04.2022	EUR	181.728	USD	200.000	Handel	Barclays	1.977
	01.04.2022	EUR	56.178	GBP	46.946	Handel	Barclays	625
	03.05.2022	EUR	9.998.486	USD	11.135.971	Handel	Barclays	208
	03.05.2022	EUR	10.955.487	GBP	9.277.227	Handel	Barclays	(9.307)
	03.05.2022	USD	378.960	EUR	341.154	Handel	Barclays	(910)
								<b>EUR (22.268)</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
	19.04.2022	USD	25.235	EUR	22.914	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(247)
	19.04.2022	GBP	308.516	EUR	364.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2022	GBP	10.695.841	EUR	12.648.625	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(375)
	19.04.2022	GBP	714	EUR	844	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	72.533	EUR	70.253	Absicherung	JP Morgan Chase New York	592
	19.04.2022	USD	632	EUR	570	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2)
	19.04.2022	GBP	7.702	EUR	9.140	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(32)
	19.04.2022	GBP	267.304	EUR	317.210	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.111)
	19.04.2022	GBP	18	EUR	21	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	1.804	EUR	1.739	Absicherung	JP Morgan Chase New York	22
	19.04.2022	EUR	125.004	GBP	104.703	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.190
	19.04.2022	GBP	5.899	EUR	7.078	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(103)
	19.04.2022	USD	649	EUR	583	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	GBP	6.585	EUR	7.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	GBP	282.043	EUR	332.541	Absicherung	JP Morgan Chase New York	986
	19.04.2022	GBP	19	EUR	22	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	CHF	1.843	EUR	1.785	Absicherung	JP Morgan Chase New York	15
								<b>EUR 947</b>
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>								
	19.04.2022	EUR	2.160.688	USD	2.379.533	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25.892
	19.04.2022	EUR	8.831	USD	9.725	Absicherung	JP Morgan Chase New York	106
	19.04.2022	EUR	3.331	USD	3.668	Absicherung	JP Morgan Chase New York	40
	19.04.2022	USD	475	EUR	432	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(6)
	19.04.2022	EUR	760	USD	835	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11
	19.04.2022	EUR	99.987	USD	110.533	Absicherung	JP Morgan Chase New York	779
	19.04.2022	EUR	409	USD	452	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3
	19.04.2022	EUR	154	USD	170	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	51.494	USD	56.975	Absicherung	JP Morgan Chase New York	351
	19.04.2022	EUR	210	USD	233	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	79	USD	88	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	132.837	EUR	120.852	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.703)
	19.04.2022	EUR	45.350	USD	50.506	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(19)
								<b>USD 25.457</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>								
	19.04.2022	EUR	930.660	USD	1.024.922	Absicherung	JP Morgan Chase New York	11.151
	19.04.2022	EUR	198.791	USD	218.925	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.382
	19.04.2022	USD	3.025	EUR	2.754	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(40)
	19.04.2022	EUR	43.090	USD	47.635	Absicherung	JP Morgan Chase New York	336
	19.04.2022	EUR	9.216	USD	10.188	Absicherung	JP Morgan Chase New York	72
	19.04.2022	EUR	20.516	USD	22.752	Absicherung	JP Morgan Chase New York	88
	19.04.2022	EUR	4.392	USD	4.871	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	EUR	22.975	USD	25.304	Absicherung	JP Morgan Chase New York	273
	19.04.2022	EUR	4.889	USD	5.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	58
								<b>USD 14.339</b>
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
	19.04.2022	EUR	4.072.735	USD	4.485.242	Absicherung	JP Morgan Chase New York	48.804
	19.04.2022	CHF	2.031.246	USD	2.167.215	Absicherung	JP Morgan Chase New York	41.465
	19.04.2022	GBP	1.051.211	USD	1.369.454	Absicherung	JP Morgan Chase New York	14.446
	19.04.2022	EUR	1.807.315	USD	1.990.368	Absicherung	JP Morgan Chase New York	21.657
	19.04.2022	EUR	8.657.886	USD	9.534.800	Absicherung	JP Morgan Chase New York	103.747
	19.04.2022	GBP	62.692.930	USD	81.672.588	Absicherung	JP Morgan Chase New York	861.526
	19.04.2022	SGD	11.028.411	USD	8.071.203	Absicherung	JP Morgan Chase New York	77.028
	19.04.2022	GBP	5.234.559	USD	6.819.269	Absicherung	JP Morgan Chase New York	71.933
	19.04.2022	EUR	203.392	USD	223.993	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.437

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	CHF	1.176	USD	1.254	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	EUR	17.220	USD	18.929	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
	19.04.2022	USD	61.586	GBP	(47.205)	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(559)
	19.04.2022	EUR	20.111	USD	22.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	282
	19.04.2022	EUR	2.198	USD	2.417	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31
	19.04.2022	USD	2.032	GBP	1.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.04.2022	SGD	438.757	USD	321.677	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.494
	19.04.2022	GBP	114.381	USD	149.226	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.355
	19.04.2022	USD	2.037	EUR	1.854	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(27)
	19.04.2022	GBP	54.806	USD	71.606	Absicherung	JP Morgan Chase New York	545
	19.04.2022	USD	57.847	EUR	52.657	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(774)
	19.04.2022	EUR	191.219	USD	210.066	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.812
	19.04.2022	USD	2.146.727	GBP	1.643.075	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(16.354)
	19.04.2022	SGD	902.232	USD	660.426	Absicherung	JP Morgan Chase New York	6.179
	19.04.2022	USD	324.429	GBP	248.313	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(2.472)
	19.04.2022	USD	62.876	EUR	57.300	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(914)
	19.04.2022	USD	30.692	CHF	28.840	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(666)
	19.04.2022	USD	18.586	GBP	14.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(182)
	19.04.2022	USD	28.106	EUR	25.614	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(409)
	19.04.2022	USD	133.057	EUR	121.257	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.934)
	19.04.2022	USD	1.159.638	GBP	889.490	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11.361)
	19.04.2022	USD	119.909	SGD	163.344	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(776)
	19.04.2022	USD	98.944	GBP	75.894	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(969)
	19.04.2022	USD	3.125	EUR	2.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(45)
	19.04.2022	USD	18	CHF	17	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	51.375	EUR	46.473	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(362)
	19.04.2022	USD	24.552	CHF	23.080	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(544)
	19.04.2022	USD	15.780	GBP	11.979	Absicherung	JP Morgan Chase New York	9
	19.04.2022	USD	22.319	EUR	20.190	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(157)
	19.04.2022	USD	111.144	EUR	100.539	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(783)
	19.04.2022	USD	908.093	GBP	689.377	Absicherung	JP Morgan Chase New York	541
	19.04.2022	USD	102.511	SGD	138.990	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(181)
	19.04.2022	USD	75.856	GBP	57.586	Absicherung	JP Morgan Chase New York	45
	19.04.2022	USD	2.555	EUR	2.311	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(18)
	19.04.2022	USD	14	CHF	13	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	50.882	EUR	46.241	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(596)
	19.04.2022	USD	121.831	GBP	93.046	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(662)
	19.04.2022	USD	20.093	EUR	18.261	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(236)
	19.04.2022	EUR	1.000	USD	1.100	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13
	19.04.2022	USD	17.969	GBP	13.724	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(98)
	19.04.2022	SGD	452.242	USD	332.383	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.752
	19.04.2022	USD	346.538	GBP	264.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.882)
	19.04.2022	EUR	113.272	USD	125.618	Absicherung	JP Morgan Chase New York	485
	19.04.2022	CHF	57.034	USD	60.977	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.040
	19.04.2022	GBP	27.295	USD	35.909	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	EUR	49.195	USD	54.557	Absicherung	JP Morgan Chase New York	210



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	248.337	USD	275.403	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.062
	19.04.2022	GBP	1.727.423	USD	2.272.598	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.523
	19.04.2022	SGD	363.220	USD	268.120	Absicherung	JP Morgan Chase New York	241
	19.04.2022	GBP	136.636	USD	179.758	Absicherung	JP Morgan Chase New York	120
	19.04.2022	EUR	5.704	USD	6.325	Absicherung	JP Morgan Chase New York	24
	19.04.2022	CHF	33	USD	35	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	106.199	EUR	95.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(126)
	19.04.2022	USD	526	GBP	400	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	11.483	EUR	10.327	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	USD	34.994	EUR	31.471	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(42)
	19.04.2022	USD	20.244	GBP	15.388	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15)
	19.04.2022	USD	133.149	SGD	180.297	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(62)
	19.04.2022	USD	161.775	GBP	122.972	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(116)
	19.04.2022	USD	133.775	EUR	120.978	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(906)
	19.04.2022	GBP	100	USD	132	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	EUR	36.578	USD	40.448	Absicherung	JP Morgan Chase New York	274
	19.04.2022	EUR	3.311	USD	3.661	Absicherung	JP Morgan Chase New York	25
	19.04.2022	GBP	621	USD	818	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	SGD	177.081	USD	130.568	Absicherung	JP Morgan Chase New York	267
	19.04.2022	USD	20.093	GBP	15.259	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4
	19.04.2022	USD	71.619	EUR	64.764	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(481)
	19.04.2022	CHF	39.950	USD	42.962	Absicherung	JP Morgan Chase New York	478
	19.04.2022	USD	22.824	GBP	17.287	Absicherung	JP Morgan Chase New York	65
	19.04.2022	USD	1.659	EUR	1.500	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(11)
	19.04.2022	GBP	1.020	USD	1.347	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	SGD	378.075	USD	278.965	Absicherung	JP Morgan Chase New York	372
	19.04.2022	GBP	123.397	USD	162.916	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(467)
	19.04.2022	EUR	780	USD	860	Absicherung	JP Morgan Chase New York	8
	19.04.2022	GBP	400	USD	530	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4)
	19.04.2022	EUR	6.240	USD	6.883	Absicherung	JP Morgan Chase New York	64
	19.04.2022	USD	1.518	EUR	1.376	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	USD	4.493	GBP	3.389	Absicherung	JP Morgan Chase New York	31
	19.04.2022	SGD	221.572	USD	163.183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	523
	19.04.2022	GBP	82.862	USD	109.856	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(770)
	19.04.2022	EUR	127.031	USD	139.551	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.869
	19.04.2022	CHF	69.599	USD	74.616	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.063
	19.04.2022	GBP	32.472	USD	42.810	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(61)
	19.04.2022	EUR	60.702	USD	66.684	Absicherung	JP Morgan Chase New York	893
	19.04.2022	EUR	299.568	USD	329.093	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.407
	19.04.2022	GBP	2.084.512	USD	2.748.135	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3.913)
	19.04.2022	SGD	450.676	USD	331.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.008
	19.04.2022	GBP	165.136	USD	217.709	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(310)
	19.04.2022	EUR	6.901	USD	7.581	Absicherung	JP Morgan Chase New York	102
	19.04.2022	CHF	40	USD	43	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	8.454	USD	9.307	Absicherung	JP Morgan Chase New York	104
	19.04.2022	GBP	54.210	USD	71.615	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(248)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISETERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeitsdatum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>	19.04.2022	EUR	4.990	USD	5.494	Absicherung	JP Morgan Chase New York	62
	19.04.2022	USD	1.391.648	EUR	1.264.086	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(15.610)
	19.04.2022	GBP	266	USD	352	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	SGD	694.549	USD	511.551	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.610
	19.04.2022	GBP	102.805	USD	135.812	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(471)
	19.04.2022	EUR	26.797	USD	29.517	Absicherung	JP Morgan Chase New York	315
	19.04.2022	GBP	3.000	USD	3.955	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(5)
	19.04.2022	EUR	33.000	USD	36.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	388
	19.04.2022	USD	68.672	EUR	62.345	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(733)
	19.04.2022	USD	2.745.368	GBP	2.082.580	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.689
	19.04.2022	SGD	659.952	USD	486.083	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1.516
	19.04.2022	GBP	7.902	USD	10.417	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(14)
	19.04.2022	EUR	41.037	USD	45.106	Absicherung	JP Morgan Chase New York	579
	19.04.2022	GBP	10.498	USD	13.849	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(28)
	19.04.2022	EUR	10.358	USD	11.385	Absicherung	JP Morgan Chase New York	146
	19.04.2022	USD	129.948	EUR	118.224	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.666)
	19.04.2022	USD	90.320	GBP	68.466	Absicherung	JP Morgan Chase New York	185
	19.04.2022	SGD	799.143	USD	588.331	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2.108
	19.04.2022	GBP	106.742	USD	140.813	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(289)
	19.04.2022	USD	185	EUR	169	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(3)
	19.04.2022	GBP	2.841	USD	3.717	Absicherung	JP Morgan Chase New York	23
	19.04.2022	EUR	47	USD	51	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	EUR	5.000	USD	5.488	Absicherung	JP Morgan Chase New York	78
	19.04.2022	USD	181.768	GBP	138.935	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.138)
	19.04.2022	SGD	1.064.937	USD	782.256	Absicherung	JP Morgan Chase New York	4.561
	19.04.2022	GBP	84.410	USD	110.433	Absicherung	JP Morgan Chase New York	691
	19.04.2022	USD	87.393	EUR	79.349	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(943)
	19.04.2022	USD	46.082	CHF	43.008	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(683)
	19.04.2022	USD	27.430	GBP	20.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(129)
	19.04.2022	USD	41.790	EUR	37.943	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(451)
	19.04.2022	USD	167.670	EUR	152.236	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.809)
	19.04.2022	USD	1.584.626	GBP	1.209.322	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(7.426)
	19.04.2022	USD	238.136	SGD	323.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1.136)
	19.04.2022	USD	138.450	GBP	105.660	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(649)
	19.04.2022	USD	4.612	EUR	4.187	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(50)
	19.04.2022	USD	26	CHF	24	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	13.112	EUR	11.804	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(29)
	19.04.2022	GBP	1.500	USD	1.970	Absicherung	JP Morgan Chase New York	5
	19.04.2022	USD	7.706	EUR	6.938	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(17)
	19.04.2022	USD	241	GBP	183	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(1)
	19.04.2022	SGD	443.607	USD	327.160	Absicherung	JP Morgan Chase New York	595
	19.04.2022	GBP	104.267	USD	136.947	Absicherung	JP Morgan Chase New York	318
	19.04.2022	USD	73.215	EUR	65.741	Absicherung	JP Morgan Chase New York	27
	19.04.2022	USD	38.673	CHF	35.880	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(341)
	19.04.2022	USD	23.014	GBP	17.537	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(73)
	19.04.2022	USD	35.019	EUR	31.444	Absicherung	JP Morgan Chase New York	13

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 9 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS DEWISENTERMINGESCHÄFTEN

(Fortsetzung)

Portfolio	Fälligkeits- datum	Währung gekauft	Betrag gekauft	Währung verkauft	Betrag verkauft	Zweck	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b> <i>(Fortsetzung)</i>								
	19.04.2022	USD	141.991	EUR	127.497	Absicherung	JP Morgan Chase New York	52
	19.04.2022	USD	1.332.225	GBP	1.015.172	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(4.230)
	19.04.2022	USD	210.687	SGD	285.344	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(136)
	19.04.2022	USD	117.476	GBP	89.518	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(373)
	19.04.2022	USD	3.883	EUR	3.487	Absicherung	JP Morgan Chase New York	1
	19.04.2022	USD	22	CHF	20	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
	19.04.2022	USD	55.677	EUR	49.848	Absicherung	JP Morgan Chase New York	182
	19.04.2022	USD	3.993	GBP	3.031	Absicherung	JP Morgan Chase New York	2
	19.04.2022	EUR	2.490	USD	2.781	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(9)
	19.04.2022	GBP	28.487	USD	37.524	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2022	USD	321.457	SGD	434.843	Absicherung	JP Morgan Chase New York	177
	19.04.2022	USD	31.872	GBP	24.196	Absicherung	JP Morgan Chase New York	19
	19.04.2022	EUR	90.128	USD	100.744	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(407)
	19.04.2022	CHF	48.637	USD	52.692	Absicherung	JP Morgan Chase New York	193
	19.04.2022	GBP	23.984	USD	31.507	Absicherung	JP Morgan Chase New York	68
	19.04.2022	EUR	43.046	USD	48.117	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(194)
	19.04.2022	EUR	175.484	USD	196.154	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(792)
	19.04.2022	GBP	1.387.442	USD	1.822.619	Absicherung	JP Morgan Chase New York	3.924
	19.04.2022	SGD	402.206	USD	297.359	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(193)
	19.04.2022	GBP	124.793	USD	163.934	Absicherung	JP Morgan Chase New York	353
	19.04.2022	EUR	4.798	USD	5.363	Absicherung	JP Morgan Chase New York	(22)
	19.04.2022	CHF	28	USD	30	Absicherung	JP Morgan Chase New York	0
								<b>USD 1.206.919</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	1.300.000	20.06.2025	24.119	0,00
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	3.300.000	20.12.2026	20.950	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	1.770.000	20.12.2026	354.086	0,06
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	74.000	20.06.2022	(653)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(1.324)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	295.000	20.06.2022	(2.604)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	185.000	20.06.2022	(1.633)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(313)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	55.000	20.06.2022	(313)	(0,00)
CDS	Barclays	Banca BPM SPA	Kauf	EUR	146.000	20.06.2022	(1.289)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	60.000	20.06.2022	(342)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	80.000	20.06.2022	(456)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	580.000	20.12.2023	(34.251)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	200.000	20.12.2023	(11.811)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	50.000	20.12.2023	(285)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	1.100.000	20.06.2026	190.924	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	17.825.000	20.12.2026	(1.570.384)	(0,29)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	17.750.000	20.12.2026	(313.485)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	20.000.000	20.12.2026	(353.222)	(0,06)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	20.000.000	20.12.2026	353.222	0,05
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	2.000.000	20.12.2026	(57.034)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	2.500.000	20.12.2026	(75.950)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	2.330.000	20.12.2026	(70.292)	(0,01)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	4.740.000	20.12.2026	(71.793)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	1.200.000	20.12.2026	(8.757)	(0,00)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	1.400.000	20.12.2026	(29.613)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	17.750.000	20.12.2026	313.485	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	17.750.000	20.06.2027	(268.632)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	17.825.000	20.06.2027	(1.439.861)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	17.825.000	20.12.2026	1.570.384	0,29
							<b>USD (1.487.127)</b>	<b>(0,29)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	2.950.000	20.06.2027	(214.168)	(0,17)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.950.000	20.12.2026	233.582	0,18
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	400.000	20.06.2026	62.398	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	21.830.000	20.12.2026	(346.508)	(0,27)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	2.950.000	20.12.2026	(233.583)	(0,19)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	4.500.000	20.12.2026	71.429	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	4.500.000	20.12.2026	71.429	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	3.300.000	20.12.2026	(52.381)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	3.000.000	20.12.2026	(47.619)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	14.930.000	20.06.2027	(203.077)	(0,16)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	14.930.000	20.12.2026	236.984	0,19
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	4.200.000	20.12.2026	66.667	0,05
							<b>EUR (354.847)</b>	<b>(0,28)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Goldman Sachs	Cellnex Telecom SA	Verkauf	EUR	300.000	20.06.2022	3.141	0,00
CDS	JPMorgan	ITRAXX Europe Crossover Series 31	Verkauf	EUR	933.340	20.06.2022	6.969	0,01
							<b>EUR 10.110</b>	<b>0,01</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	325.000	20.12.2023	(17.249)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	900.000	20.06.2025	15.007	0,01
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2026	25.090	0,01
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2026	9.700	0,01
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	61.000	20.06.2022	(484)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	120.000	20.06.2022	(952)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	245.000	20.06.2022	(1.943)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	150.000	20.06.2022	(1.190)	(0,00)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	900.000	20.12.2026	1.728	0,00
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(845)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(845)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	124.000	20.06.2022	(984)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	165.000	20.06.2022	(845)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Verkauf	EUR	235.000	20.06.2022	(1.203)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Glencore International	Verkauf	EUR	600.000	20.06.2026	93.596	0,05
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	800.000	20.06.2023	(37.283)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	22.600.000	20.12.2026	(1.789.477)	(0,96)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	35.520.000	20.12.2026	(563.809)	(0,30)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	4.000.000	20.12.2026	63.492	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Kauf	EUR	4.340.000	20.12.2026	78.749	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Kauf	USD	17.730.000	20.12.2026	(273.748)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	8.700.000	20.12.2026	138.095	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	6.000.000	20.12.2026	95.238	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	5.800.000	20.12.2026	92.063	0,05
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	1.700.000	20.12.2026	134.607	0,07
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Kauf	EUR	1.100.000	20.12.2026	29.593	0,02
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	1.750.000	20.12.2026	(44.852)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2026	(7.753)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Kauf	EUR	537.500	20.12.2026	(8.789)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	2.200.000	20.12.2026	(32.753)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	2.190.000	20.12.2026	(29.812)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	1.700.000	20.12.2026	(46.417)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	2.160.000	20.12.2026	(58.566)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	800.000	20.12.2026	(5.247)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	5.000.000	20.12.2026	(395.902)	(0,21)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	6.200.000	20.12.2026	95.727	0,05
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	1.870.000	20.12.2026	(35.549)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	3.730.000	20.12.2026	59.206	0,03
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	7.290.000	20.06.2027	(99.158)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	7.290.000	20.12.2026	115.714	0,06
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	25.900.000	20.06.2027	(1.880.322)	(1,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	25.900.000	20.12.2026	2.050.772	1,10
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	4.340.000	20.12.2026	(78.748)	(0,04)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Kauf	EUR	4.340.000	20.06.2027	114.399	0,06
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Kauf	USD	11.530.000	20.06.2027	(166.254)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	11.530.000	20.12.2026	178.021	0,10
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Verkauf	USD	11.530.000	20.06.2027	166.255	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	7.290.000	20.06.2027	99.158	0,05
							<b>EUR (1.924.769)</b>	<b>(1,03)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	3.600.000	20.12.2026	317.160	0,71
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	3.340.000	20.12.2026	57.378	0,13

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Verkauf	USD	3.340.000	20.06.2027	53.586	0,12
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	3.600.000	20.06.2027	290.799	0,65
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Kauf	USD	3.340.000	20.12.2026	(57.378)	(0,13)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	3.600.000	20.12.2026	(317.160)	(0,72)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	800.000	20.06.2027	(64.622)	(0,14)
							<b>USD 279.763</b>	<b>0,62</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert USD	% des Nettovermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(9.001)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	255.000	20.12.2026	(22.466)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	2.250.000	20.12.2026	(39.738)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	70.000	20.12.2026	(1.996)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	870.000	20.12.2026	15.365	0,01
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	90.000	20.12.2026	(2.734)	(0,00)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	130.000	20.12.2026	(1.969)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	80.000	20.12.2026	1.314	0,00
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	40.000	20.12.2026	8.002	0,00
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	70.000	20.12.2026	(1.481)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	800.000	20.12.2026	14.129	0,01
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Kauf	USD	1.000.000	20.12.2026	(17.179)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	400.000	20.12.2026	6.872	0,00
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	600.000	20.12.2026	10.307	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	880.000	20.12.2026	15.542	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	880.000	20.06.2027	(13.318)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	255.000	20.06.2027	(20.598)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	255.000	20.12.2026	22.465	0,01
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	570.000	20.12.2026	10.067	0,01
							<b>USD (26.417)</b>	<b>(0,02)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien und Erhalt des US 1M LIBOR.	USD	3.018.372	20.04.2023	(32.644)	(0,13)
TRS	UBS	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 13 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 42 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	9.302.106	26.06.2023	(107.980)	(0,44)
							<b>USD (140.624)</b>	<b>(0,57)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	100.000	20.06.2022	(793)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.855.000	20.06.2022	(22.646)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	5.810.000	20.06.2022	(46.086)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	3.645.000	20.06.2022	(28.913)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.477.000	20.06.2022	(11.716)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(19.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(19.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	3.765.000	20.06.2022	(19.273)	(0,00)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	2.853.000	20.06.2022	(22.631)	(0,00)
CDS	JPMorgan	BCP Finance Bank	Kauf	EUR	5.185.000	20.06.2022	(26.542)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	21.150.000	20.12.2022	(601.867)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Kauf	EUR	17.700.000	20.12.2026	(585.477)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Arcelormittal	Kauf	EUR	7.500.000	20.12.2023	(562.146)	(0,06)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	5.690.000	20.12.2026	83.976	0,01
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	14.200.000	20.12.2026	27.272	0,00
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	10.220.000	20.12.2026	(202.936)	(0,02)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	24.700.000	20.12.2026	140.930	0,01
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	9.830.000	20.12.2026	(120.894)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	4.000.000	20.12.2026	719.178	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	179.150.000	20.12.2026	(14.185.167)	(1,45)
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	1.000.000	20.06.2022	(7.932)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	3.950.000	20.06.2025	65.864	0,01
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Kauf	EUR	500.000	20.06.2022	(2.560)	(0,00)
CDS	Barclays	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	4.600.000	20.12.2026	8.834	0,00
CDS	Barclays	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	400.000	20.06.2022	(3.173)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	600.000	20.12.2022	(17.074)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Kauf	EUR	900.000	20.06.2022	(4.607)	(0,00)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	1.200.000	20.12.2022	(34.148)	(0,00)



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	97.450.000	20.12.2026	(1.546.825)	(0,16)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Kauf	EUR	22.180.000	20.12.2026	(265.224)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Kauf	EUR	25.090.000	20.12.2026	455.258	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	4.400.000	20.12.2026	(69.841)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Kauf	USD	301.650.000	20.12.2026	(4.657.429)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	64.800.000	20.12.2026	1.028.571	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	64.800.000	20.12.2026	(1.028.571)	(0,10)
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	16.100.000	20.12.2026	(412.640)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	6.250.000	20.12.2026	(37.273)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Kauf	EUR	10.860.000	20.12.2026	(206.912)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Kauf	EUR	19.355.000	20.12.2026	(316.498)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	16.700.000	20.12.2026	(248.628)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	15.800.000	20.12.2026	(431.406)	(0,04)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	13.500.000	20.12.2026	(183.773)	(0,02)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	18.560.000	20.12.2026	(503.232)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	4.115.000	20.12.2026	(67.720)	(0,01)
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Kauf	EUR	7.500.000	20.12.2026	32.965	0,00
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	22.210.000	20.12.2026	154.197	0,02
CDS	Barclays	Natwest Group	Kauf	EUR	10.540.000	20.12.2026	98.990	0,01
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	23.030.000	20.12.2026	(498.850)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	9.700.000	20.12.2026	(63.621)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Kauf	EUR	19.000.000	20.12.2026	(91.263)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	17.600.000	20.12.2026	(1.393.575)	(0,14)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	24.580.000	20.12.2026	379.511	0,04
CDS	Barclays	Sanofi SA	Kauf	EUR	8.900.000	20.12.2026	(309.120)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	24.000.000	20.12.2026	380.952	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	40.000.000	20.12.2026	634.921	0,06
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	37.850.000	20.12.2026	600.794	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	37.850.000	20.06.2027	(514.833)	(0,05)
CDS	BNP Paribas	British Telecommunications plc	Kauf	EUR	15.000.000	20.06.2027	(5.139)	(0,00)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	196.750.000	20.06.2027	(14.283.914)	(1,46)
CDS	BNP Paribas	Monitchem Holdco 3 S.A.	Kauf	EUR	10.000.000	20.06.2027	(940.184)	(0,10)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	196.750.000	20.12.2026	15.578.742	1,58
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Verkauf	EUR	25.090.000	20.12.2026	(455.258)	(0,05)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Kauf	EUR	25.090.000	20.06.2027	661.355	0,07
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Kauf	EUR	22.180.000	20.06.2027	(212.460)	(0,02)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Verkauf	EUR	22.180.000	20.12.2026	265.224	0,03
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Kauf	USD	277.070.000	20.06.2027	(3.995.158)	(0,41)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	277.070.000	20.12.2026	4.277.918	0,43
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Verkauf	USD	92.430.000	20.06.2027	1.332.776	0,14
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	37.850.000	20.06.2027	514.833	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	34.680.000	20.06.2027	471.713	0,05
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	200.000.000	15.06.2022	(789.219)	(0,08)
CDS	Barclays	TRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	200.000.000	15.06.2022	2.310.393	0,24
							<b>EUR (19.848.526)</b>	<b>(2,02)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Credit-Default-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Kauf	EUR	2.910.000	20.06.2027	(211.264)	(0,47)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.910.000	20.12.2026	230.415	0,52
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(598)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Pearson PLC	Kauf	EUR	40.000	20.06.2023	(336)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banca Popolare Di Milano	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.298)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(773)	(0,00)
CDS	Citigroup Global Markets	Tesco plc	Kauf	EUR	80.000	20.06.2023	(797)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Airbus SE	Verkauf	EUR	350.000	20.06.2025	5.836	0,01
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	60.000	20.06.2023	(598)	(0,00)
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	590.000	20.12.2026	8.708	0,02
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	700.000	20.12.2026	(13.900)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	Lloyds Banking Group	Kauf	EUR	2.600.000	20.12.2026	14.835	0,03
CDS	Goldman Sachs	Barclays plc	Kauf	EUR	350.000	20.12.2026	(4.304)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Coöperatieve Rabobank U.A.	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2026	2.497	0,01
CDS	JPMorgan	Banco Commercial Portugues SA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(773)	(0,00)
CDS	JPMorgan	United Utilities Group	Kauf	EUR	80.000	20.12.2023	(1.186)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	30.000	20.06.2023	(1.298)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	145.000	20.12.2023	(7.696)	(0,02)
CDS	Barclays	Tesco plc	Kauf	EUR	100.000	20.12.2023	(1.260)	(0,00)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	260.000	20.12.2023	(3.277)	(0,01)
CDS	JPMorgan	Banco BPM SPA	Kauf	EUR	250.000	20.12.2023	(13.269)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	2.910.000	20.12.2026	(230.415)	(0,52)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	7.320.000	20.12.2026	(116.190)	(0,26)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Kauf	EUR	1.250.000	20.12.2026	(14.947)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Kauf	EUR	3.810.000	20.12.2026	69.133	0,15
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	300.000	20.12.2026	4.762	0,01

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.100.000	20.12.2026	33.333	0,07
CDS	Goldman Sachs	Fortum OYJ	Kauf	EUR	425.000	20.12.2026	11.433	0,03
CDS	Goldman Sachs	Veolia Environment	Kauf	EUR	830.000	20.12.2026	(21.273)	(0,05)
CDS	Goldman Sachs	Anglo American plc	Verkauf	EUR	190.000	20.12.2026	34.161	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	200.000	20.12.2026	(3.175)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Kauf	USD	15.250.000	20.12.2026	(235.458)	(0,53)
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	1.580.000	20.12.2026	24.395	0,05
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.820.000	20.12.2026	44.762	0,10
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.200.000	20.12.2026	34.921	0,08
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	300.000	20.12.2026	(4.762)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	2.100.000	20.12.2026	(33.333)	(0,07)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	1.100.000	20.12.2026	17.460	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	300.000	20.12.2026	4.762	0,01
CDS	JPMorgan	Electricite DE	Kauf	EUR	400.000	20.12.2026	(2.385)	(0,01)
CDS	JPMorgan	General Motors Company	Kauf	USD	500.000	20.12.2026	(64.222)	(0,14)
CDS	JPMorgan	Bayerische Motoren Werke AG	Kauf	EUR	600.000	20.12.2026	(11.432)	(0,03)
CDS	JPMorgan	Diamler AG	Kauf	EUR	1.077.500	20.12.2026	(17.620)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Tesco plc	Kauf	EUR	450.000	20.12.2026	(6.700)	(0,02)
CDS	Barclays	Standard Chartered plc	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2026	(17.697)	(0,04)
CDS	JPMorgan	Telia Co AB	Kauf	EUR	900.000	20.12.2026	(24.574)	(0,06)
CDS	JPMorgan	Swedbank AB	Kauf	EUR	850.000	20.12.2026	(23.047)	(0,05)
CDS	JPMorgan	Henkel AG & Co	Kauf	EUR	1.300.000	20.12.2026	(43.001)	(0,10)
CDS	Barclays	Natwest Group	Kauf	EUR	1.030.000	20.12.2026	9.674	0,02
CDS	Bank of America Merrill Lynch	ING Groep NV	Kauf	EUR	740.000	20.12.2026	3.253	0,01
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	735.000	20.12.2026	(12.096)	(0,03)
CDS	Goldman Sachs	HSBC Holdings	Kauf	EUR	1.570.000	20.12.2026	10.900	0,02
CDS	Citigroup Global Markets	Westpac banking Corp.	Kauf	USD	1.700.000	20.12.2026	(36.823)	(0,08)
CDS	JPMorgan	Societe Generale SA	Kauf	EUR	1.000.000	20.12.2026	(4.803)	(0,01)
CDS	Goldman Sachs	Banco Bilbao Vizcaya	Kauf	EUR	650.000	20.12.2026	(4.263)	(0,01)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	1.000.000	20.12.2026	15.873	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	1.200.000	20.12.2026	19.048	0,04
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	2.200.000	20.12.2026	34.921	0,08
CDS	JPMorgan	Natural Energy Group SA	Kauf	EUR	800.000	20.12.2026	(6.038)	(0,01)
CDS	JPMorgan	SSE plc	Kauf	EUR	960.000	20.12.2026	(18.250)	(0,04)
CDS	Barclays	Sanofi SA	Kauf	EUR	1.100.000	20.12.2026	(38.206)	(0,09)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Kauf	EUR	3.300.000	20.12.2026	(52.381)	(0,12)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	3.300.000	20.06.2027	44.886	0,10

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Kauf/Verkauf	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 36	Verkauf	EUR	3.810.000	20.12.2026	(69.133)	(0,15)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINUB 37	Kauf	EUR	3.810.000	20.06.2027	100.429	0,23
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 37	Kauf	EUR	1.250.000	20.06.2027	(11.975)	(0,03)
CDS	Morgan Stanley	ITRAXX FINSR 36	Verkauf	EUR	1.250.000	20.12.2026	14.947	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.37	Verkauf	USD	13.670.000	20.12.2026	211.063	0,47
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Kauf	USD	13.670.000	20.06.2027	(197.113)	(0,44)
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	1.300.000	20.06.2027	17.683	0,04
CDS	Morgan Stanley	CDX.NA.IG.38	Verkauf	USD	2.780.000	20.06.2027	40.086	0,09
CDS	Morgan Stanley	TRAXX Europe Crossover Series 37	Verkauf	EUR	2.180.000	20.06.2027	29.652	0,07
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	50.000.000	15.06.2022	(56.103)	(0,13)
CDS	Barclays	ITRAXX Europe Crossover Series 36	Verkauf	EUR	50.000.000	15.06.2022	152.212	0,34
							<b>EUR (394.002)</b>	<b>(0,88)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien und Erhalt des 1 M EONIA -0,35 %.	EUR	6.833.090	vom 05.05.2027 bis zum 24.10.2029	(78.503)	(0,06)
TRS	Goldman Sachs	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M SONIA -0,35 %.	GBP	1.550.134	18.05.2029	(74.572)	(0,06)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M TOIS.	CHF	4.819.687	05.02.2024	155.534	0,13
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des 1M CIBOR.	DKK	22.971.273	05.02.2024	(32.848)	(0,03)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien und Erhalt des 1M EONIA.	EUR	23.458.053	05.02.2024	(332.756)	(0,28)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M NIBOR.	NOK	24.987.392	05.02.2024	25.081	0,02
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 6 Aktien und Erhalt des 1M STIBOR.	SEK	125.868.661	05.02.2024	291.061	0,24
							<b>EUR (47.003)</b>	<b>(0,04)</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Bank of America Merrill Lynch	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 4 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	31.305.403	20.04.2023	(211.444)	(0,17)
TRS	UBS	Nordamerika Aktienkorb	Zahlung von US-1M-LIBOR +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 13 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 42 Aktien und Erhalt des US-1M-LIBOR.	USD	32.895.157	26.06.2023	(318.592)	(0,25)
							<b>USD (530.036)</b>	<b>(0,42)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung	Kontrahent	Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des AUD 1M LIBOR +0,40 %.	AUD	4.003.187	10.01.2025	(254.367)	(0,26)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des 1M CIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	CHF	1.610.786	01.12.2022	106.599	0,11
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von DKDRA +0,30 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien.	DKK	2.451.500	08.01.2025	41.815	0,04
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung von 1M EURIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie und Erhalt des 1M-EONIA.	EUR	1.854.311	10.01.2025	18.215	0,02
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des GBP 1M LIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Aktien und Erhalt des GBP 1M-LIBOR.	GBP	2.571.753	10.01.2025	(175.417)	(0,18)
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des NOK 1M LIBOR und Erhalt der Wertentwicklung der zugrunde liegenden Aktie.	NOK	8.472.153	10.03.2025	13.535	0,01

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 10 NICHT REALISIRTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS SWAPS

(Fortsetzung)

Beschreibung Kontrahent		Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	UBS	Aktienkorb	Zahlung des US 1M LIBOR +0,35 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 20 Aktien. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 16 Aktien und Erhalt des US 1M LIBOR.	USD	45.548.569	10.01.2025	2.115.332	2,14
							<b>USD 1.865.712</b>	<b>1,88</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities die folgenden ausstehenden Total-Return-Swap-Kontrakte:

Beschreibung Kontrahent		Zugrunde liegend/ Emittent	Zahlung/Erhalt	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter (Verlust) in der Portfolio- Basiswährung	% des Netto- vermögens
TRS	Citigroup	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,14 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index.	USD	44.592.767	06.04.2022	1.627.423	0,30
TRS	Credit Suisse	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,25 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index.	USD	42.144.562	04.04.2022	1.538.075	0,28
TRS	Goldman Sachs	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,11 % und Erhalt der Wertentwicklung des BCOMF3 Index. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 3 Indizes und Erhalt von 0,11 %.	USD	221.178.746	04.04.2022	5.805.622	1,05
TRS	JPMorgan	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0 bis 0,27 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 24 Indizes. Zahlung der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 22 Indizes.	USD	1.397.179.007	vom 31.03.2022 bis zum 04.04.2022	3.701.658	0,68
TRS	Macquarie	Nordamerika Rohstoffkorb	Zahlung von 0,17 % und Erhalt der Wertentwicklung des zugrunde liegenden Korbes von 2 Indizes.	USD	144.458.250	04.04.2022	5.184.353	0,95
							<b>USD 17.857.131</b>	<b>3,26</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

Zum 31. März 2022 ist der Kontrahent von ausstehenden Terminkontrakten UBS.

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(258)	EUR	(27.470.848)	08.06.2022	2.433.054	0,48
Euro-BOBL Future	Verkäufe	(110)	EUR	(12.182.972)	08.06.2022	526.042	0,10
Euro-BUXL 30 Year Future	Verkäufe	(18)	EUR	(2.873.815)	08.06.2022	316.418	0,06
Euro-OAT Future	Verkäufe	(29)	EUR	(3.404.088)	08.06.2022	240.674	0,05
10-Year Australian Treasury Bond Future	Kauf	10	AUD	951.777	15.06.2022	(37.262)	(0,01)
10-Year US Treasury Note	Kauf	161	USD	16.318.859	21.06.2022	(690.839)	(0,13)
Government of Canada Bond Futures	Kauf	58	CAD	4.249.802	21.06.2022	(220.987)	(0,04)
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(47)	USD	(4.876.250)	21.06.2022	245.508	0,05
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(259)	USD	(23.771.344)	21.06.2022	1.241.988	0,24
US Treasury Bond Future	Kauf	86	USD	10.880.344	21.06.2022	(530.758)	(0,10)
UK Treasury Future	Verkäufe	(95)	GBP	(15.561.546)	28.06.2022	266.917	0,05
5-Year US Treasury Note	Kauf	646	USD	59.956.875	30.06.2022	(2.035.940)	(0,40)
US Treasury Bond Future	Kauf	27	USD	5.381.016	30.06.2022	(80.624)	(0,02)
						<b>USD 1.674.191</b>	<b>0,33</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(67)	EUR	(6.411.632)	08.06.2022	550.994	0,43
Euro-BUXL 30 Year Future	Verkäufe	(8)	EUR	(1.147.936)	08.06.2022	121.332	0,10
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(4)	USD	(364.389)	21.06.2022	15.385	0,01
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(12)	USD	(989.867)	21.06.2022	58.961	0,05
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(5)	USD	(568.533)	21.06.2022	27.421	0,02
						<b>EUR 774.093</b>	<b>0,61</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(31)	USD	(2.824.015)	21.06.2022	93.545	0,02
						<b>EUR 93.545</b>	<b>0,02</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Social Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(31)	EUR	(2.966.576)	08.06.2022	1.410	0,00
Euro-BTP Future	Verkäufe	(4)	EUR	(365.796)	08.06.2022	19.746	0,00
Short Euro-BTP Future	Verkäufe	(1)	EUR	(102.552)	08.06.2022	1.130	0,00
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(48)	USD	(4.372.669)	21.06.2022	182.255	0,05
UK Treasury Future	Verkäufe	(168)	GBP	(24.733.173)	28.06.2022	361.652	0,10
5-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(18)	USD	(1.501.483)	30.06.2022	52.928	0,01
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(4)	USD	(716.476)	30.06.2022	10.751	0,00
						<b>EUR 629.872</b>	<b>0,16</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(221)	EUR	(21.148.816)	08.06.2022	1.987.849	1,06
Euro-BOBL Future	Verkäufe	(166)	EUR	(16.523.806)	08.06.2022	797.923	0,43
Euro-BUXL 30 Year Future	Verkäufe	(24)	EUR	(3.443.808)	08.06.2022	406.057	0,22
Euro-SCHATZ Future	Verkäufe	(7)	EUR	(700.868)	08.06.2022	9.758	0,01
Euro-OAT Future	Kauf	13	EUR	1.371.474	08.06.2022	(107.523)	(0,06)
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(31)	USD	(2.824.015)	21.06.2022	111.422	0,06
US Treasury Bond Future	Kauf	3	USD	279.738	21.06.2022	(17.952)	(0,01)
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(55)	USD	(4.536.888)	21.06.2022	227.542	0,12
US Treasury Bond Future	Kauf	13	USD	1.478.186	21.06.2022	(72.108)	(0,04)
UK Treasury Future	Verkäufe	(63)	GBP	(9.274.940)	28.06.2022	159.087	0,09



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
5-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(8)	USD	(667.326)	30.06.2022	23.861	0,01
						<b>EUR 3.525.916</b>	<b>1,89</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds den folgenden ausstehenden Terminkontrakt:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(45)	USD	(4.561.172)	21.06.2022	192.573	0,47
						<b>USD 192.573</b>	<b>0,47</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(3)	USD	(311.250)	21.06.2022	16.611	0,05
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(6)	USD	(550.688)	21.06.2022	24.177	0,07
						<b>USD 40.788</b>	<b>0,12</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(60)	USD	(6.081.563)	21.06.2022	198.170	0,22
5-Year US Treasury Note	Kauf	95	USD	8.817.188	30.06.2022	(259.933)	(0,29)
						<b>USD (61.763)</b>	<b>(0,07)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(20)	USD	(2.027.188)	21.06.2022	66.057	0,11
						<b>USD 66.057</b>	<b>0,11</b>

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
SGX MSCI Taiwan Index Future	Kauf	11	USD	683.935	28.04.2022	9.106	0,03
TOPIX Index	Kauf	8	JPY	1.153.073	09.06.2022	103.167	0,31
KOSPI 200 Index	Kauf	10	KRW	677.933	09.06.2022	35.291	0,10
FTSE 100 Index	Kauf	9	GBP	797.268	17.06.2022	36.048	0,11
S&P 500 Future	Kauf	12	USD	2.443.221	17.06.2022	169.007	0,50
						<b>EUR 352.619</b>	<b>1,05</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
SGX MSCI Taiwan Index Future	Kauf	2	USD	138.360	28.04.2022	1.842	0,00
KOSPI 200 Index	Kauf	2	KRW	15.086.039	09.06.2022	7.853	0,02
TOPIX Index	Kauf	22	JPY	352.815.699	09.06.2022	315.669	0,70
S&P 500 Future	Verkäufe	(65)	USD	(14.724.938)	17.06.2022	(1.099.474)	(2,45)
FTSE 100 Index	Kauf	9	GBP	887.080	17.06.2022	44.425	0,10
Euro Stoxx Future	Verkäufe	(55)	EUR	(2.339.514)	17.06.2022	(82.657)	(0,18)
						<b>USD (812.342)</b>	<b>(1,81)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(8)	EUR	(851.809)	08.06.2022	74.506	0,05
Euro-BOBL Future	Verkäufe	(7)	EUR	(775.280)	08.06.2022	35.275	0,02
Euro-OAT Future	Verkäufe	(1)	EUR	(117.382)	08.06.2022	8.299	0,01
S&P 500 Future	Kauf	76	USD	17.216.850	17.06.2022	551.247	0,38
10-Year US Treasury Note Future	Kauf	1	USD	101.359	21.06.2022	(4.291)	(0,00)
Government of Canada Bond Futures	Kauf	2	CAD	146.545	21.06.2022	(7.620)	(0,01)
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(5)	USD	(458.906)	21.06.2022	27.215	0,02
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(1)	USD	(126.516)	21.06.2022	6.117	0,00
UK Treasury Future	Verkäufe	(3)	GBP	(491.417)	28.06.2022	8.429	0,01
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	5	USD	464.063	30.06.2022	(16.644)	(0,01)

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
US Treasury Bond Future	Kauf	2	USD	398.594	30.06.2022	(5.972)	(0,00)
						<b>USD 676.561</b>	<b>0,47</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
S&P 500 Future	Verkäufe	(53)	USD	(12.006.488)	17.06.2022	(894.660)	(3,62)
						<b>USD (894.660)</b>	<b>(3,62)</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(567)	EUR	(54.259.632)	08.06.2022	4.678.310	0,48
Euro-BOBL Future	Verkäufe	(1.049)	EUR	(104.418.509)	08.06.2022	4.750.951	0,47
Euro-BUXL 30 Year Future	Verkäufe	(56)	EUR	(8.035.552)	08.06.2022	884.746	0,09
Euro-OAT Future	Verkäufe	(210)	EUR	(22.154.580)	08.06.2022	1.566.360	0,16
10-Year US Treasury Note	Verkäufe	(294)	USD	(26.782.597)	21.06.2022	1.080.009	0,11
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(37)	USD	(3.450.097)	21.06.2022	190.005	0,02
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(316)	USD	(26.066.485)	21.06.2022	1.427.029	0,15
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(66)	USD	(7.504.634)	21.06.2022	361.955	0,04
UK Treasury Future	Verkäufe	(673)	GBP	(99.079.913)	28.06.2022	1.659.924	0,17
5-Year US Treasury Note	Kauf	70	USD	5.839.100	30.06.2022	(4.738)	(0,00)
						<b>EUR 16.594.551</b>	<b>1,69</b>

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities die folgenden ausstehenden Terminkontrakte:

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
Euro-BUND Future	Verkäufe	(62)	EUR	(5.933.152)	08.06.2022	470.591	1,04
Euro-BOBL Future	Verkäufe	(36)	EUR	(3.583.476)	08.06.2022	158.565	0,36
Euro-BUXL 30 Year Future	Verkäufe	(3)	EUR	(430.476)	08.06.2022	47.397	0,11
Euro-SCHATZ Future	Verkäufe	(2)	EUR	(200.248)	08.06.2022	2.528	0,01
Euro-OAT Future	Verkäufe	(8)	EUR	(843.984)	08.06.2022	59.671	0,13

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 11 NICHT REALISierter NETTOGEWINN/(-VERLUST) AUS TERMINKONTRAKTEN

(Fortsetzung)

Beschreibung	Status	Anzahl der Kontrakte	Währung	Fiktive Verpflichtungen in der Portfolio-Basiswährung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
10-Year US Treasury Note Future	Verkäufe	(11)	USD	(1.002.070)	21.06.2022	40.468	0,09
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(3)	USD	(279.738)	21.06.2022	11.574	0,03
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(28)	USD	(2.309.689)	21.06.2022	125.470	0,28
US Treasury Bond Future	Verkäufe	(3)	USD	(341.120)	21.06.2022	16.452	0,04
UK Treasury Future	Verkäufe	(39)	GBP	(5.741.629)	28.06.2022	98.525	0,22
5-Year US Treasury Note Future	Kauf	6	USD	500.494	30.06.2022	(220)	(0,00)
						<b>EUR 1.031.021</b>	<b>2,31</b>

### 12 OPTIONEN ZUM MARKTWERT

Zum 31. März 2022 hatte Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income die folgenden ausstehenden Optionen:

Beschreibung	Kontrahent	Ausübungspreis	Währung	Kontrakte	Fälligkeitsdatum	Engagement in der Portfolio-Basiswährung	Marktwert in der Portfolio-Basiswährung	% des Nettovermögens
<b>Optionen auf Futures</b>								
Call S&P 500 Index	UBS	4.480,000	USD	(59)	08.04.2022	22.095.154*	(564.511)	(0,40)
Call DJ Euro Stoxx 50	UBS	3.925,000	EUR	(116)	14.04.2022	2.486.829*	(80.280)	(0,06)
Call FTSE 100 Index	UBS	7.475,000	GBP	(40)	14.04.2022	2.568.131*	(63.463)	(0,04)
						<b>USD (708.254)</b>	<b>(0,50)</b>	

\*Das Engagement in Short-Call-Positionen ist unbegrenzt.

### 13 POOLING

Die SICAV kann die Gesamtheit oder einen Teil des Vermögens zweier oder mehrerer Portfolios („teilnehmende Portfolios“) in Form eines Pools anlegen und verwalten. Ein solcher Vermögenspool wird durch Übertragung von Barmitteln oder anderen Vermögenswerten der jeweiligen teilnehmenden Portfolios gebildet (wobei diese Vermögenswerte im Hinblick auf die Anlagepolitik des betreffenden Pools geeignet sein müssen).

Der Anteil eines teilnehmenden Portfolios an einem Vermögenspool wird anhand von rechnerischen Anteilen (Units) gleichen Werts an dem Vermögenspool bestimmt.

Zum 31. März 2022 verfügte die SICAV über kein Pooling von Vermögenswerten, jedoch ist das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio zu Anlageverwaltungszwecken nach Anlageklassen in mehrere Körbe aufgeteilt, die ausschließlich von ihm selbst gehalten werden.

### 14 ÄNDERUNGEN BEI DEN PORTFOLIOAUFGESTELLUNGEN

Änderungen bei den Portfolioaufstellungen werden den Anteilhabern auf Anfrage am eingetragenen Firmensitz der SICAV kostenlos zur Verfügung gestellt.

### 15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

Die Portfolios können aufgrund von Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen von einer Verringerung des Nettoinventarwerts je Anteil betroffen sein. Dieser entsteht, wenn der Unterberater Käufe und Verkäufe von zugrunde liegenden Anlagen vornimmt, um Mittelzu- und Abflüsse zu ermöglichen – dies ist als „Verwässerung“ bekannt. Eine Verwässerungsanpassung kann vorgenommen werden, um die Anteilhaber des Portfolios zu schützen, indem den Auswirkungen einer Verwässerung entgegengewirkt wird (die „Verwässerungsanpassung“). Wenn die Nettokapitalaktivitäten (einschließlich Zeichnungen, Rückgaben und Umtausch in ein bestimmtes Portfolio) an einem bestimmten Bewertungstag die von der Verwaltungsgesellschaft gegebenenfalls für dieses Portfolio festgelegte Schwelle übersteigen, kann der Nettoinventarwert des Portfolios nach oben oder nach unten angepasst werden, um den Nettozuflüssen bzw. den Nettoabflüssen Rechnung zu tragen.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 15 VERWÄSSERUNGSANPASSUNG

(Fortsetzung)

Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse im Portfolio wird separat berechnet, aber jede Verwässerungsanpassung wirkt sich identisch auf den Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilklasse des Portfolios aus. Die Höhe der Verwässerungsanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft festgelegt, um die geschätzten Handelsspreads, Transaktionskosten und Steueraufwendungen, die möglicherweise für das Portfolio anfallen, zu berücksichtigen. Diese Kosten können je nach Marktbedingungen und Portfoliozusammensetzung schwanken. Die Verwässerungsanpassung kann daher gegebenenfalls geändert werden. Diese Verwässerungsanpassung kann je nach Portfolio und den täglichen Nettozuflüssen und -abflüssen variieren und ist auf maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil beschränkt (mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity\* Portfolios, bei dem die Verwässerungsanpassung nicht mehr als 5 % des ursprünglichen Nettoinventarwertes je Anteil betragen wird). Die Angemessenheit der Verwässerungsanpassungen wird regelmäßig überprüft. Im normalen Geschäftsverlauf wird die Anwendung der Verwässerungsanpassung konsequent mechanisch ausgelöst. Die Verwaltungsgesellschaft behält sich jedoch das Recht vor, in ihrem eigenen Ermessen eine Verwässerungsanpassung vorzunehmen, wenn sie der Ansicht ist, dass dies im besten Interesse der bestehenden Anteilinhaber ist, wie z. B. unter anderem im Falle außergewöhnlicher Umstände. Bei solchen außergewöhnlichen Umständen kann es sich unter anderem um Phasen mit einer erhöhten Marktvolatilität und Phasen mit einer reduzierten Marktliquidität handeln.

Die Verwässerungsanpassung kann auf sämtliche Portfolios mit Ausnahme des Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities Portfolios angewendet werden.

Schätzungen zur Höhe der Verwässerungsanpassung auf der Grundlage der in jedem Portfolio gehaltenen Wertpapiere sowie der Marktbedingungen zum Datum des Verkaufsprospekts (November 2021) werden auf der Website [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com) veröffentlicht.

Zum 31. März 2022 war die folgende Verwässerungsanpassung vorgenommen worden:

Portfolio	NIW vor Verwässerung	Verwässerungsanpassung	NIW nach Verwässerung
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	475.145.184	(332.602)	474.812.582

\*Siehe Erläuterung 1.

### 16 TRANSAKTIONS-KOSTEN

Für das Berichtsjahr entstanden der SICAV wie folgt Transaktionskosten bezüglich des Kaufs oder Verkaufs von übertragbaren Wertpapieren oder Geldmarktinstrumenten:

Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	7.224
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Social Bond <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond <sup>1</sup>	USD	k. A.
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	EUR	705
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	USD	13.836
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	USD	40.891
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities	USD	9.744
Threadneedle (Lux) - Global Focus	USD	1.466.730
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities	USD	168.383
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	USD	209.049
Threadneedle (Lux) - Global Select	USD	237.619
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	EUR	1.817.331
Threadneedle (Lux) - American	USD	212.331
Threadneedle (Lux) - American Select	USD	140.540
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	USD	150.428
Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity	USD	355.408
Threadneedle (Lux) - Asia Equities	USD	804.959
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	USD	129.628
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities	USD	14.361
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities	EUR	694.762
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend	EUR	102.396
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities	EUR	376.652
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	1.153.129
Threadneedle (Lux) - European Select	EUR	1.111.256
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies	EUR	434.055
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	76.799
Threadneedle (Lux) - Global Technology	USD	162.082
Threadneedle (Lux) - UK Equities	GBP	667.317
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	GBP	279.775
Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity <sup>2</sup>	USD	60.597
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	USD	6.617

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 16 TRANSAKTIONSKOSTEN

(Fortsetzung)

Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities <sup>1</sup>	EUR	k. A.
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	EUR	510.300
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	USD	34.905
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	USD	70.056
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	2.790

Die Transaktionskosten sind in den Gesamtkosten der Anlage gemäß den Portfolioaufstellungen enthalten. Der Betrag der während des Berichtsjahres von der SICAV getragenen Transaktionskosten ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens unter der Überschrift „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Wertpapierverkäufen“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Wertpapieren“ enthalten.

<sup>1</sup>Bei festverzinslichen Wertpapieren sind die Transaktionskosten nicht vom Kaufpreis des Wertpapiers getrennt ermittelbar und können daher nicht getrennt ausgewiesen werden.

<sup>2</sup>Siehe Erläuterung 1.

### 17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

In der nachstehenden Tabelle sind die von den Portfolios erhaltenen und gezahlten Barsicherheitsalden zum 31. März 2022 dargestellt:

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
<b>Vom Portfolio gezahlte Sicherheiten</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	160.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Lloyds	Termingeschäfte	EUR	10.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	200.000
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Lloyds	Termingeschäfte	EUR	570.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	Barclays	Termingeschäfte	USD	260.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Lloyds	Termingeschäfte	USD	10.000
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	20.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	490.000
Threadneedle (Lux) - European Select	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	210.000
Threadneedle (Lux) - UK Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	30.000
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income	JPM Chase	Termingeschäfte	GBP	110.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	140.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	UBS	Swaps	USD	310.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	EUR	320.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Swaps	EUR	550.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	BNP Paribas	Swaps	EUR	820.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	EUR	100.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Citigroup Global Markets	Termingeschäfte und Swaps	EUR	130.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	250.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Goldman Sachs	Swaps	EUR	90.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	870.000
<b>Vom Portfolio erhaltene Sicherheiten</b>				
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Goldman Sachs	Termingeschäfte und Swaps	USD	380.000
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	USD	3.268.880
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	5.030.000
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	50.000
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	1.250.000
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Barclays	Termingeschäfte	EUR	470.000
Threadneedle (Lux) - European Social Bond	HSBC	Termingeschäfte	EUR	340.000
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	400.000
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	430.000
Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	630.000
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	150.000
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	110.000

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 17 INFORMATIONEN ZU SICHERHEITEN

(Fortsetzung)

Portfolios	Kontrahent	Anlageart	Währung	Barsicherheiten
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	USD	110.000
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	1.080.000
Threadneedle (Lux) - Global Focus	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.450.000
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	EUR	80.000
Threadneedle (Lux) - American	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	2.490.000
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	130.000
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	840.000
Threadneedle (Lux) - Global Technology	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	740.000
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	JPM Chase	Termingeschäfte	USD	240.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	EUR	120.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Barclays	Termingeschäfte und Swaps	EUR	700.000
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	JPM Securities	Termingeschäfte und Swaps	EUR	2.650.000
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Goldman Sachs	Swaps	EUR	70.000
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	UBS	Swaps	EUR	20.000
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Bank of America Merrill Lynch	Swaps	USD	99.000
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	UBS	Swaps	USD	1.920.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Credit Suisse	Swaps	USD	2.070.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Citigroup Global Markets	Swaps	USD	2.191.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Macquarie	Swaps	USD	7.050.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Goldman Sachs	Swaps	USD	8.050.000
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	JPM Chase	Termingeschäfte und Swaps	USD	8.500.000

### 18 ÜBERKREUZBETEILIGUNGEN IN PORTFOLIOS

Zum 31. März 2022 investierte das Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Cross Investment Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens in der Basiswährung des Cross Investment Portfolio
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	EUR	2.648.205	0,54
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond	EUR	2.469.877	1,93
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	EUR	714.888	0,87
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	EUR	3.233.732	7,25
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond	EUR	1.357.249	0,31
Threadneedle (Lux) - Global Focus	EUR	3.141.191	0,15
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies	EUR	1.082.041	0,09
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	EUR	3.471.871	3,21

Zum 31. März 2022 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Cross Investment Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens in der Basiswährung des Cross Investment Portfolio
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	USD	3.650.129	0,67
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	68.290	0,07
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	USD	62.775	0,05

Zum 31. März 2022 investierte das Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income Portfolio in Anteile folgender Portfolios:

Portfolio	Währung	Marktwert	% des Nettovermögens in der Basiswährung des Cross Investment Portfolio
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income	USD	286.675	0,55
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds	USD	214.969	0,24

Die Auswirkungen der Transaktionen im Rahmen von Überkreuzbeteiligungen wurden aus der aggregierten Aufstellung des Nettovermögens und der Aufstellung der Entwicklung des Nettovermögens entfernt.

Bitte lesen Sie auch Erläuterung 2 xi) zur Rückvergütung von Anlageverwaltungsgebühren.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 19 TERMINEINLAGEN

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2022 gehaltenen Termineinlagen:

Portfolios	Kontrahent	Währung	Betrag der Termineinlagen (in der Basiswährung des Portfolios)
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return	BNP Paribas Paris	EUR	641.677
	<b>Gesamt</b>	<b>EUR</b>	<b>641.677</b>
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Sumitomo Bank Ltd London	EUR	22.045.718
	<b>Gesamt</b>	<b>EUR</b>	<b>22.045.718</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	ANZ Banking Group Ltd	USD	3.000.597
	Mitsubishi UFJ Securities	USD	3.001.034
	<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>6.001.631</b>

### 20 SONSTIGE PASSIVA

Die sonstigen Passiva umfassen Anpassungen des beizulegenden Zeitwerts, die vorgenommen wurden, als bestimmte Märkte zum Jahresende geschlossen waren, um Market Timing zu verhindern, auf der Grundlage des bestehenden Preisbestimmungsverfahrens auf der Fondsebene.



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

Die Gesamtkostenquote wird gemäß der Richtlinie der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) ermittelt.

Die verwendete Formel lautet wie folgt:

Die TER erfasst sämtliche den Anteilklassen fortlaufend belasteten Provisionen und Kosten (Betriebskosten) rückwirkend als prozentualen Anteil des Nettovermögens der Anteilklassen und wird anhand der folgenden Formel berechnet:

$$\text{TER \%} = \frac{\text{Gesamtbetriebskosten}}{\text{Durchschnittliches Nettovermögen}} \times 100$$

Wenn ein Fonds mehr als 10 % in andere Organismen für gemeinsame Anlagen (Zielfonds) investiert, umfasst die Berechnung den Anteil des Fonds an den Aufwendungen der Zielfonds abzüglich erhaltener Gebührennachlässe.

Die Gesamtkostenquote für das Berichtsjahr bis zum 31. März 2022 beträgt:

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b>	AEC	0,85 %	
	AEH	0,85 %	
	AKH	0,94 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	0,85 %	
	AUP	0,85 %	
	DEC	1,60 %	
	DEH	1,60 %	
	DU	1,60 %	
	DUP	1,60 %	
	IEC	0,65 %	
	IEH	0,65 %	
	IEP	0,65 %	
	IGC	0,65 %	
	IGH	0,65 %	
	IKH	0,65 %	
	INH	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,65 %	
	IUP	0,65 %	
	NEC	0,45 %	
	NEH	0,45 %	
	NGC	0,45 %	
	NGH	0,45 %	
NU	0,45 %		
NUP	0,45 %		
XEH	0,07 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
XFH	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
XGH	0,15 %		
XU	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZEH	0,60 %		
ZFH	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZGH	0,60 %		
ZU	0,60 %		
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>	AE	1,20 %	
	ANH	1,27 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,60 %	
	IEP	0,60 %	
	INH	0,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
XE	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b> (Fortsetzung)	XFH	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XGH	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XUH	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,78 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	1E	1,19 %	
	1G	1,19 %	
	2E	0,58 %	
	2G	0,58 %	
	3G	0,69 %	
	4E	0,08 %	
	4G	0,08 %	
	8E	0,62 %	
	8G	0,62 %	
	9G	0,65 %	
	<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>	AE	1,55 %
AKH		1,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ANH		1,66 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
IE		0,85 %	
IEP		0,85 %	
IKH		0,85 %	
INH		0,85 %	
XE		0,15 %	
ZE		0,90 %	
ZEP		0,90 %	
1E		1,38 %	
1EP		1,38 %	
1G		1,38 %	
1GP		1,38 %	
1UT		1,38 %	
2E		0,82 %	
2EP		0,82 %	
2FH		0,82 %	
2G		0,82 %	
2GP		0,82 %	
3E		0,77 %	
3EP		0,77 %	
3FC		0,77 %	
3FH		0,77 %	
3G		0,77 %	
3GP		0,77 %	
4E		0,07 %	
4G		0,07 %	
8E		0,86 %	
8EP		0,86 %	
8FH	0,86 %		
8G	0,86 %		
8GP	0,86 %		
9E	0,73 %		
9EP	0,73 %		
9FC	0,73 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b> (Fortsetzung)	9FH	0,73 %	
	9G	0,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	9GP	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>	AE	0,90 %	
	AEP	0,90 %	
	AKH	0,84 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,82 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,50 %	
	IEP	0,50 %	
	IGC	0,44 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,44 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IKH	0,50 %	
	INH	0,50 %	
	XE	0,10 %	
	XGC	0,10 %	
	XGH	0,10 %	
	ZE	0,55 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>	AE	0,55 %	
	AEP	0,55 %	
	AFH	0,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AKH	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	0,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASC	0,55 %	
	ASH	0,55 %	
	AUC	0,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUH	0,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ID	0,40 %	
	IE	0,40 %	
	IEP	0,40 %	
	IFH	0,40 %	
	IGH	0,40 %	
	IKH	0,40 %	
	INH	0,40 %	
	ISC	0,57 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISH	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IUC	0,40 %	
	IUH	0,40 %	
	LE	0,40 %	
	NEP	0,40 %	
	ZD	0,45 %	
	ZE	0,45 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b> (Fortsetzung)	ZEP	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZGC	0,45 %	
	ZGH	0,45 %	
	ZUH	0,45 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>	AE	1,15 %	
	AEP	1,15 %	
	AKH	1,27 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,25 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUH	1,15 %	
	DE	1,70 %	
	DEP	1,70 %	
	DUH	1,70 %	
	IE	0,55 %	
	INH	0,47 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,65 %	
	ANH	1,71 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEC	1,75 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEC	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	W	1,30 %	
	WEH	1,30 %	
	XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>	AEC	1,65 %	
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,70 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ANH	1,65 %	
	ASH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEH	0,85 %	
	IU	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	SU	1,80 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b> (Fortsetzung)	SUP	1,80 %	
	W	1,30 %	
	XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,90 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>	AEC	1,60 %	
	AEH	1,60 %	
	AKH	1,60 %	
	ANH	1,60 %	
	ASC	1,60 %	
	ASH	1,60 %	
	AU	1,60 %	
	AUP	1,60 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZEH	0,90 %	
	ZU	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AKH	1,55 %	
	ANH	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	1,75 %	
	DEH	1,75 %	
	DU	1,75 %	
	IEC	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	0,65 %	
	IKH	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	INH	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ISC	0,65 %	
	IU	0,65 %	
	TEH	0,65 %	
	XUP	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	0,97 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	0,95 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZU	0,90 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>	AEH	1,15 %	
	AKH	1,15 %	
	AS	1,15 %	
	ASC	1,15 %	
	ASH	1,15 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b> (Fortsetzung)	AU	1,15 %	
	AUP	1,15 %	
	AVC	1,26 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AVH	1,23 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	1,45 %	
	IEH	0,55 %	
	IGH	0,55 %	
	ISH	0,50 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,55 %	
	XU	0,15 %	
	ZU	0,65 %	
ZUP	0,65 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>	AE	1,63 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	AEP	1,72 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	DE	2,38 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	IE	0,93 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	IEP	0,93 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	LE	0,78 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	LEP	0,73 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	ZE	1,13 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	ZEP	1,18 %	Die Schweizer Gesamtkostenquote umfasst die synthetischen Kosten für das Halten der zugrunde liegenden Anlagen, die während des Berichtszeitraums annualisiert 8 Basispunkten entsprechen.
	<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>	AEC	1,65 %
	AEH	1,65 %	
	AKH	1,65 %	
	AU	1,65 %	
	AUP	1,65 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	1,01 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IGH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	1,75 %	
	ZU	1,09 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>	AE	1,55 %	
	AEC	1,55 %	
	AEH	1,55 %	
	AEP	1,55 %	
	AS	1,66 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASC	1,55 %	
	ASH	1,55 %	
	ASP	1,55 %	
	AU	1,55 %	
	AUM	1,55 %	
	AUP	1,55 %	
	DEC	2,30 %	
	DEH	2,30 %	
	DEP	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	DUP	2,30 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEC	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
ZFH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
ZUP	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	IE	0,86 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	0,86 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IG	0,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IU	0,80 %	
	LE	0,50 %	
	LG	0,56 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEC	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
ZU	1,05 %		
ZUP	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>	AEH	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
IUP	0,95 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b> (Fortsetzung)	W	1,75 %	
	XU	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	IE	0,95 %	
	IEH	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	XU	0,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
	1E	1,71 %	
	1U	1,71 %	
	2E	1,10 %	
	2U	1,10 %	
8E	1,14 %		
8U	1,14 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>	AEC	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEC	2,30 %	
	DUP	2,21 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	IU	0,95 %	
	TE	1,19 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1SC	1,68 %	
	1SH	1,68 %	
	1ST	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	1UP	1,68 %	
	1VT	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2EP	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	2UP	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3U	0,93 %	
	3UP	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	8EP	1,11 %	
	8U	1,11 %	
	8UP	1,11 %	
9E	0,89 %		



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b> (Fortsetzung)	9EP	0,89 %	
	9U	0,89 %	
	9UP	0,81 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - Global Select</b>	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2E	1,07 %	
	2U	1,07 %	
	3U	0,90 %	
	8E	1,11 %	
	8U	1,11 %	
	9U	0,86 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>	AE	1,80 %	
	AEP	1,80 %	
	AK	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DE	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IEP	0,95 %	
	NE	0,75 %	
	XE	0,15 %	
	XFH	0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XG	0,15 %	
	XGH	0,15 %	
	XU	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
ZGH	1,05 %		
ZU	1,05 %		
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,15 %	
	DU	2,15 %	
	IEH	0,90 %	
	IU	0,90 %	
	W	1,50 %	
	ZE	1,00 %	
	ZEH	1,00 %	
	ZU	1,00 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2E	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3EH	0,88 %	
3U	0,88 %		
8E	1,10 %		
8U	1,10 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - American</b> (Fortsetzung)	9EH	0,84 %	
	9U	0,84 %	
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>	AD	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AN	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	ID	1,00 %	
	IE	1,00 %	
	IEH	1,00 %	
	IN	1,00 %	
	W	1,75 %	
	ZEH	1,10 %	
	ZU	1,10 %	
	1E	1,67 %	
	1EH	1,67 %	
	1EP	1,67 %	
	1U	1,67 %	
	2EH	1,06 %	
	2U	1,06 %	
	3E	0,87 %	
	3U	0,87 %	
8EH	1,10 %		
8U	1,10 %		
9E	0,83 %		
9U	0,83 %		
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,68 %	
	1EP	1,68 %	
	1U	1,68 %	
	2U	1,07 %	
	3EH	0,93 %	
	3U	0,93 %	
	8U	1,11 %	
9EH	0,89 %		
9U	0,89 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>	AE	1,80 %	
	AF	1,89 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AS	1,80 %	
	ASH	1,80 %	
	AU	1,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	DE	2,55 %	
	IF	0,95 %	
	ISH	0,95 %	
	IU	0,95 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b> (Fortsetzung)	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,25 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	ZF	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZU	1,05 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>	AE	1,87 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEH	1,87 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DE	2,35 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,38 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,70 %	
	1U	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2U	1,09 %	
	3U	0,95 %	
	8E	1,13 %	
	8U	1,13 %	
	9U	0,91 %	
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>	AEC	1,85 %	
	AEH	1,85 %	
	AU	1,85 %	
	AUP	1,85 %	
	DU	2,35 %	
	IU	1,05 %	
	XS	0,15 %	
	XSH	0,15 %	
	ZEH	1,10 %	
	ZFH	1,10 %	
	ZGH	1,10 %	
	ZU	1,10 %	
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>	AE	0,70 %	
	AEH	0,70 %	
	AU	0,70 %	
	AUP	0,70 %	
	DE	0,90 %	
	DEH	0,84 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	DU	0,90 %	
	IE	0,35 %	
	IEC	0,35 %	
	IEH	0,35 %	
	IFH	0,35 %	
	IG	0,35 %	
	IU	0,35 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b> (Fortsetzung)	NE	0,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,20 %	
	NU	0,20 %	
	XG	0,10 %	
	ZEH	0,45 %	
	ZFH	0,45 %	
	ZU	0,45 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>	AE	1,55 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,55 %	
	AUH	1,55 %	
	DE	1,75 %	
	IE	0,80 %	
	W	1,75 %	
	XE	0,15 %	
	ZE	1,00 %	
	ZUH	1,00 %	
	1E	1,53 %	
	1EP	1,59 %	
	1G	1,53 %	
	1GP	1,59 %	
	2E	1,08 %	
	2G	1,08 %	
	2U	1,02 %	
	3E	0,94 %	
	3G	0,94 %	
	3GP	0,94 %	
	4E	0,08 %	
4G	0,08 %		
8E	1,12 %		
8G	1,12 %		
8U	1,03 %		
9E	0,90 %		
9G	0,90 %		
9GP	0,90 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>	AE	1,80 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. September 2021 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AEP	1,80 %	
	AUP	1,86 %	
	DE	2,15 %	
	DEP	2,15 %	
	IE	0,82 %	
	IEP	0,65 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEP	1,05 %	
	1E	1,70 %	
1EP	1,70 %		
1G	1,70 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b> (Fortsetzung)	1GP	1,70 %	
	2E	1,09 %	
	2EP	0,99 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2G	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	2GP	1,02 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	3EP	0,95 %	
	3G	0,95 %	
	3GP	0,95 %	
	4GP	0,09 %	
	8E	1,13 %	
	8EP	1,13 %	
	8G	1,13 %	
	8GP	1,13 %	
	9EP	0,91 %	
	9G	0,91 %	
	9GP	0,91 %	
	<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>	AE	1,85 %
ASH		1,85 %	
AUH		1,85 %	
DE		2,75 %	
DUH		2,75 %	
IE		1,10 %	
W		1,90 %	
XE		0,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
ZE		1,10 %	
ZFH		1,10 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	1G	1,72 %	
	1UH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	2G	1,07 %	
	3E	0,91 %	
	3EP	0,91 %	
	3FH	0,91 %	
	3G	0,91 %	
	3GP	0,91 %	
	3UH	0,91 %	
	4E	0,07 %	
	4G	0,07 %	
8E	1,11 %		
8G	1,11 %		
9E	0,87 %		
9EP	0,87 %		
9FH	0,87 %		
9G	0,87 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b> (Fortsetzung)	9GP	0,87 %	
	9UH	0,87 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>	AE	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AUH	1,80 %	
	DUH	2,35 %	
	IE	0,95 %	
	ZE	1,18 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens und der kürzlichen Auflegung der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZG	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	1E	1,65 %	
	1EP	1,65 %	
	1SH	1,65 %	
	1U	1,65 %	
	1UH	1,65 %	
	2E	1,06 %	
	2EP	1,06 %	
	3E	0,88 %	
	3U	0,88 %	
	8E	1,10 %	
	8EP	1,10 %	
	9E	0,84 %	
	9U	0,84 %	
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>	IE	0,95 %	
	ZE	1,10 %	
	1E	1,72 %	
	1EP	1,72 %	
	1FH	1,72 %	
	2E	1,07 %	
	3E	0,93 %	
	3EP	0,93 %	
	3FH	0,93 %	
	8E	1,11 %	
	9E	0,89 %	
	9EP	0,89 %	
	9FH	0,89 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	AUP	1,80 %	
	DEH	2,55 %	
	DU	2,55 %	
	DUP	2,55 %	
	IEP	0,95 %	
	IU	0,95 %	
	W	2,00 %	
	XU	0,15 %	
	XUP	0,15 %	
	ZG	1,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZGH	1,05 %	
	ZGP	1,10 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	1,05 %	
	ZUP	1,05 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>	AEH	1,95 %	
	AS	1,95 %	
	AU	1,95 %	
	AUP	1,95 %	
	BU	2,35 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IE	1,05 %	
	IEH	1,05 %	
	IG	1,05 %	
	IU	1,05 %	
	ZEH	1,15 %	
	ZFH	1,15 %	
	ZG	1,06 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
ZU	1,15 %		
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>	AE	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	AGP	1,80 %	
	DEH	2,60 %	
	DG	2,60 %	
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	NEH	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NFH	0,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,68 %	
	NGP	0,59 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NUH	0,68 %	
	TEH	0,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TFH	0,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TG	0,63 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TGP	0,62 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	TUH	0,72 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
3EH	0,87 %		
3FH	0,87 %		
3UH	0,87 %		
9EH	0,83 %		
9EP	0,83 %		
9FH	0,83 %		
9G	0,83 %		
9UH	0,83 %		

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>	AE	1,80 %	
	AEC	1,80 %	
	AEH	1,80 %	
	AG	1,80 %	
	ASC	1,88 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUC	1,80 %	
	DE	2,55 %	
	DEC	2,42 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	DEH	2,55 %	
	DG	2,55 %	
	DGP	2,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,85 %	
	IEH	0,85 %	
	IG	0,85 %	
	IGP	0,85 %	
	IU	0,85 %	
	IUH	0,72 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LG	0,70 %	
	LGP	0,70 %	
	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZFH	1,05 %	
	ZG	1,05 %	
	ZGP	1,05 %	
	ZUH	1,05 %	
	1EH	1,64 %	
	1FH	1,64 %	
1UH	1,64 %		
3EH	0,88 %		
3FH	0,88 %		
3UH	0,88 %		
9EH	0,84 %		
9FH	0,91 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
9G	0,84 %		
9UH	0,84 %		
<b>Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity*</b>	IU	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Aussetzung der Anlageverwaltungsgebühr für diese Anteilklasse am 18. Juni 2021 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZU	0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Aussetzung der Anlageverwaltungsgebühr für diese Anteilklasse am 18. Juni 2021 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>	AEH	1,80 %	
	AFH	1,80 %	
	AGH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IEH	0,95 %	
	IGH	0,95 %/1,24 %	
	IU	0,95 %/1,26 %	
XGH	0,15 %		



## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER'	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b> (Fortsetzung)	ZE	1,05 %	
	ZEH	1,05 %	
	ZGH	1,05 %	
	ZU	1,05 %/1,38 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>	AE	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IE	0,49 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZE	0,70 %	
	1E	1,17 %	
	1EP	1,17 %	
	1GH	1,17 %	
	1UH	1,17 %	
	2E	0,56 %	
	2EP	0,56 %	
	2GC	0,56 %	
	2GH	0,56 %	
	4GH	0,06 %	
	8E	0,60 %	
	8EP	0,60 %	
	8GC	0,60 %	
	8GH	0,60 %	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>	AE	1,20 %	
	AFH	1,20 %	
	AKH	1,20 %	
	ANH	1,26 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AUH	1,20 %	
	DE	1,75 %	
	IE	0,55 %	
	IEP	0,55 %	
	IGH	0,55 %	
	INH	0,55 %	
	IU	0,55 %	
	IUH	0,55 %	
	JE	0,45 %	
	JGH	0,45 %/0,40 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	JUH	0,45 %	
	LE	0,40 %	
	LEP	0,30 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	LGH	0,28 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XE	0,15 %	
	XGH	0,15 %	
XUH	0,15 %		
YE	0,71 %/ 0,69 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
YGH	0,68 %/0,60 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
YUH	0,74 %/0,72 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZE	0,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
ZFH	0,70 %		
ZGH	0,70 %		
ZUH	0,76 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>	AE	1,85 %/2,08 %	
	AEP	1,85 %/2,03 %	
	AUH	1,85 %/2,46 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b> (Fortsetzung)	DE	2,35 %/2,64 %	
	IE	0,95 %/1,72 %	
	IGH	0,95 %/1,81 %	
	LE	0,575 %/1,62 %	
	XGH	0,15 %	
	ZE	1,05 %/1,50 %	
	ZF	1,11 %/0,96 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ZFH	1,05 %/1,90 %	
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>	ZGH	1,05 %/1,64 %	
	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,69 %	
	1EH	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
	3U	0,94 %	
	8E	0,87 %	
	8U	0,87 %	
9U	0,85 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens der Klasse von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.	
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>	AEH	1,80 %	
	AU	1,80 %	
	DEH	2,30 %	
	DU	2,30 %	
	IU	0,90 %	
	ZU	1,05 %	
	1E	1,69 %	
	1U	1,69 %	
	2E	0,83 %	
	2U	0,83 %	
8E	0,87 %		
8U	0,87 %		
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>	AEH	1,75 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AFH	1,74 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AGH	1,77 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	ASH	1,67 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	AU	1,65 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DEH	2,19 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	DU	2,09 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	IEH	0,95 %	
	IG	0,95 %	
	IGH	0,95 %	

## Erläuterungen zum Abschluss

(Fortsetzung)

### 21 GESAMTKOSTENQUOTE (TER)

(Fortsetzung)

Portfolio	Klasse	TER/TER <sup>1</sup>	Kommentare
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b> (Fortsetzung)	IU	1,00 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	NG	0,68 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund der Reduzierung der Gebühren für diese Anteilklasse am 1. Dezember 2021 und der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW von der für das volle Jahr erwarteten Gesamtkostenquote ab.
	XU	0,15 %	
	ZEH	1,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	ZFH	1,05 %	Die aktuelle Gesamtkostenquote weicht aufgrund des geringen Volumens aufgrund der starken Schwankung des durchschnittlichen NIW.
	ZGH	1,00 %	
	ZU	1,00 %	

<sup>1</sup>Die TER versteht sich einschließlich Performancegebühren.

\*Siehe Erläuterung 1.

### 22 SONSTIGE INFORMATIONEN

Die von der Coronavirus-Krankheit 2019 und ihren Varianten (COVID-19) verursachte Pandemie hat zu erheblichen globalen wirtschaftlichen und gesellschaftlichen Störungen und Marktvolatilität geführt und könnte dies auch weiterhin tun, u. a. aufgrund von Störungen des Marktzugangs, der Verfügbarkeit von Ressourcen und des Betriebs von Anlagen sowie der Erhebung von Zöllen, der Einführung von Exportkontrollen und Unterbrechungen der Lieferketten. Diese Störungen können durch Quarantänen und Reisebeschränkungen, die Verlagerung von Arbeitskräften und den Verlust von Personal und anderen Ressourcen verursacht oder verschlimmert werden. Die Auswirkungen sowie die Ungewissheit über die künftigen Auswirkungen von COVID-19 – und die Ausbrüche anderer Infektionskrankheiten, Epidemien und Pandemien, die möglicherweise in der Zukunft auftreten – könnten die globalen Volkswirtschaften und Märkte in einer Weise beeinträchtigen, die nicht unbedingt vorhersehbar ist. Darüber hinaus können die Auswirkungen von Ausbrüchen und Epidemien von Infektionskrankheiten in Schwellenländern größer sein, da Gesundheitssysteme, Regierungen und Finanzmärkte dort im Allgemeinen weniger gut etabliert sind. Durch den Ausbruch von COVID-19 verursachte Krisen im Bereich der öffentlichen Gesundheit können andere bereits bestehende politische, soziale und wirtschaftliche Risiken in bestimmten Ländern oder weltweit verschärfen. Die durch COVID-19 verursachten Störungen könnten die Portfolios daran hindern, vorteilhafte Anlageentscheidungen rechtzeitig auszuführen, und die Fähigkeit der Portfolios beeinträchtigen, ihre Anlageziele zu erreichen. Jedes dieser Ereignisse könnte erhebliche negative Auswirkungen auf den Wert und das Risikoprofil der Portfolios haben.

Der massive Einmarsch Russlands in die Ukraine im Februar 2022 hat Sanktionen und Marktstörungen nach sich gezogen, darunter Volatilität an den regionalen und globalen Aktien- und Rohstoffmärkten sowie eine erhebliche Abwertung der russischen Währung. Das Ausmaß und die Dauer der Militäraktion lassen sich nicht vorhersagen, könnten jedoch erheblich sein. Die durch die russische Militäraktion verursachten Marktstörungen sowie etwaige Gegenmaßnahmen oder Reaktionen darauf (einschließlich internationaler Sanktionen, einer Herabstufung der Kreditwürdigkeit des Landes, Kauf- und Finanzierungsbeschränkungen, Boykotte, Zölle, Änderungen der Verbraucher- oder Käuferpräferenzen, Cyberangriffe und Spionage) könnten schwerwiegende nachteilige Auswirkungen auf die regionalen und/oder globalen Wertpapier- und Rohstoffmärkte haben, unter anderem auch auf die Märkte für Erdöl und Erdgas. Diese und andere damit zusammenhängende Ereignisse könnten sich negativ auf die Wertentwicklung des Portfolios und den Wert einer Anlage in die Portfolios auswirken.

## Gesamtrisiko (ungeprüft)

### Gesamtrisiko und Leverage

Das Gesamtrisiko des OGAW wird unter einem Commitment-Ansatz, einem absoluten Value-at-Risk-Ansatz (absoluter VaR) oder einem relativen Value-at-Risk-Ansatz (relativer VaR) verwaltet.

Die Informationen zum Gesamtmarktrisiko für das Berichtsjahr zum 31. März 2022 lauten wie folgt:

### Commitment-Ansatz

Alle Portfolios, die nicht unter den VaR-Ansatz fallen, wenden zur Kontrolle und Bemessung des Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz an.

Das Gesamtrisiko der Teilfonds wird auf Grundlage des Commitment-Ansatzes in Übereinstimmung mit der in den ESMA-Richtlinien 10-788 beschriebenen Methodik berechnet.

Für den Zeitraum von April 2021 bis März 2022:

Teilfonds, die einen VaR-Ansatz nutzen	Berechnungsmethode*	VaR-Modell*	Referenzportfolio	Interne VaR-Leitlinien (%)	Rechtliche und vertragliche VaR-Grenze (%)	Einjährig rollierend				
						Niedrigste Nutzung der VaR-Grenze	Höchste Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliche Nutzung der VaR-Grenze	Durchschn. Commitment-Engagement	Durchschnittliche Summe der Nennwerte
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond	Relativer VaR	Kovarianz	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (USD Hedged)	1,5 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	99,62 %	109,03 %	103,11 %	51,17 %	109,90 %
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond	Relativer VaR	Kovarianz	ICE BofA Custom Index 0-4 Year European Currency High Yield, BB-B, 3% Constrained, Excluding Subordinated Debt (EUR Hedged)	1,5 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	76,75 %	113,00 %	97,47 %	1,38 %	27,66 %
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond	Relativer VaR	Kovarianz	ICE BofA 1-7 Year All Euro Government Index (20%), ICE BofA 1-10 Year Euro Corporate Index (40%), ICE BofA European Currency High Yield Constrained Index (40%)	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	81,30 %	101,42 %	94,46 %	82,34 %	119,90 %
Threadneedle (Lux) Flexible Asian Bond	Relativer VaR	Kovarianz	J.P. Morgan Asia Credit Index Diversified	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	88,68 %	114,17 %	98,27 %	9,29 %	13,91 %

**Gesamtrisiko (ungeprüft)**

(Fortsetzung)

Teilfonds, die einen VaR-Ansatz nutzen	Berechnungsmethode*	VaR-Modell*	Referenzportfolio	Interne VaR-Leitlinien (%)	Rechtliche und vertragliche VaR-Grenze (%)	Einjährig rollierend				
						Niedrigste Nutzung der VaR-Grenze	Höchste Nutzung der VaR-Grenze	Durchschnittliche Nutzung der VaR-Grenze	Durchschn. Commitment-Engagement	Durchschnittliche Summe der Nennwerte
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income	Relativer VaR	Kovarianz	MSCI ACWI Index (45%), ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index (USD Hedged) (30%), Bloomberg Global Aggregate Index (USD Hedged) (20%), 30-day Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR) (5%)	1,8 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	43,13 %	118,24 %	102,05 %	21,82 %	81,09 %
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	8	20	2,46 %	5,32 %	3,47 %	39,08 %	82,11 %
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	10	20	4,63 %	9,41 %	6,63 %	56,88 %	56,88 %
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	3,3	20	0,74 %	1,17 %	0,87 %	197,46 %	253,61 %
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities	Absoluter VaR	Kovarianz	k. A.	4,7	20	0,82 %	1,32 %	1,01 %	138,09 %	181,26 %
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Relativer VaR	Kovarianz	MSCI ACWI Index	1,6 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	94,39 %	122,42 %	107,06 %	98,26 %	98,26 %
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Relativer VaR	Kovarianz	S&P 500 Index	1,6 x Benchmark-VaR	2,0 x Benchmark-VaR	95,24 %	113,12 %	103,96 %	49,41 %	49,41 %
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Relativer VaR	Historisch	Bloomberg Commodity Index	1,3 x Benchmark-VaR	1,3 x Benchmark-VaR	90,37 %	111,55 %	101,14 %	13,50 %	516,91 %

\*Berechnungsmethode. Das VaR-Modell basiert auf einem Konfidenzintervall von 99 % bei einer einmonatigen Haltedauer. Das Kovarianz-Modell verwendet Daten aus 2 Jahren, gewichtet mit einer Halbwertszeit von 6 Monaten, und wird täglich aktualisiert. Bei der historischen Methode werden tägliche Daten aus einem Jahr verwendet.

## Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

Die SICAV ist eine im Großherzogtum Luxemburg entsprechend der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 10. August 1915 gegründete Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („*Société d'Investissement à Capital Variable*“) und gilt gemäß Teil I der aktuellen Fassung des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW).

Die SICAV wurde am 10. Februar 1995 für unbegrenzte Dauer gegründet. Die Satzung der SICAV wurde erstmalig am 31. März 1995 im *Recueil des Sociétés et Associations* des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und mit Wirkung zum 14. September 2018 zuletzt geändert.

Die SICAV ist unter der Nummer R.C.S. Luxemburg B-50216 eingetragen.

Die Jahreshauptversammlung der Anteilinhaber der SICAV findet, wie in der Versammlungsmitteilung angegeben, innerhalb von sechs Monaten nach Ablauf des Rechnungsjahres in Luxemburg statt. Die Jahreshauptversammlung kann im Ausland abgehalten werden, wenn außergewöhnliche Umstände dies nach dem absoluten und endgültigen Urteil des Verwaltungsrats erfordern. Sonstige Hauptversammlungen der Anteilinhaber können zu den Terminen und an den Orten in Luxemburg abgehalten werden, die in der Versammlungsmitteilung angegeben sind. Versammlungsmitteilungen erfolgen gemäß luxemburgischem Recht und im Einklang mit den maßgeblichen Regelungen der Länder, in denen die Anteile öffentlich angeboten werden. Die Versammlungsmitteilung muss Ort und Termin der Versammlung, die Teilnahmevoraussetzungen, die Tagesordnung, die Mindestanwesenheitsanforderungen zur Beschlussfähigkeit und die Voraussetzungen für die Stimmabgabe enthalten.

Das Rechnungsjahr der SICAV endet am 31. März eines jeden Jahres.

Der Jahresbericht und der geprüfte Jahresabschluss sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht sind am eingetragenen Firmensitz der SICAV und am Hauptsitz der einzelnen Zahl- und Vertriebsstellen erhältlich. Die konsolidierten Abschlüsse der SICAV werden in US-Dollar ausgedrückt.

Der Nettoinventarwert sowie die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Anteile der SICAV werden am eingetragenen Firmensitz der SICAV veröffentlicht.

Dieser Bericht stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf von Anteilen der SICAV dar. Zeichnungen werden nur auf der Grundlage des Verkaufsprospekts, des letzten verfügbaren Jahresberichts mit dem geprüften Jahresabschluss zum 31. März und, sofern danach veröffentlicht, des letzten verfügbaren Halbjahresberichts zum 30. September akzeptiert.

Bestimmte Portfolios und/oder Anteilklassen in diesem Bericht sind zu diesem Datum möglicherweise nicht in allen Rechtsordnungen zugelassen oder werden nicht in allen Rechtsordnungen zum Kauf angeboten.

### Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“) - Zeichnungsanforderungen

Das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen (Key Investor Information Document, KIID) ist ein vorvertragliches Dokument und Anleger müssen bestätigen, dass sie das neueste KIID gelesen haben, bevor sie eine Zeichnung tätigen. Die Verwaltungsgesellschaft darf einen Zeichnungsantrag ablehnen, wenn ein Anleger bei Antragstellung nicht bestätigt, dass er das neueste KIID zur Kenntnis genommen hat. Das neueste KIID ist auf [www.columbiathreadneedle.com](http://www.columbiathreadneedle.com) erhältlich.

### Angaben zur Vergütungspolitik

Die Threadneedle-Gruppe („die Gruppe“) wurde mit Wirkung vom 16. Juli 2021 von der in Luxemburg gegründeten Threadneedle Asset Management Holdings Sàrl in die in England gegründete TAM UK International Holdings Limited („UK HoldCo“ oder „die Gesellschaft“) überführt. Diese Angaben werden in Bezug auf die Vergütungspolitik der Gruppe gemacht, wie sie für Threadneedle Management Luxembourg S.A. („der Manager“) im Hinblick auf die Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) und andere anwendbare Regeln und Vorschriften gilt.

Die Vergütungspolitik gilt für alle Tochtergesellschaften der Gesellschaft, die den Auflagen der OGAW-Richtlinie unterliegen, und wurde zuletzt im Dezember 2021 vom Vergütungsausschuss genehmigt.

#### 1. Der Vergütungsausschuss

Der Vergütungsausschuss von UK HoldCo („der Ausschuss“) ist ein Unterausschuss des Verwaltungsrats von UK HoldCo, der für die Entwicklung der Philosophie und der Ziele, die die Grundlage der Vergütungs- und Leistungsprogramme der Gruppe bilden, die Überprüfung und Genehmigung von Vergütungs- und Leistungsplänen, Richtlinien und Praktiken sowie für die Aufsicht und Genehmigung der Vergütung der Gruppe zuständig ist. Es wurde festgelegt, dass der Ausschuss unabhängig von den täglichen Geschäftsaufgaben der Gruppe sein muss. Seine Mitglieder sind Verwaltungsratsmitglieder der Gruppe, die von Ameriprise Financial, der Muttergesellschaft der Gruppe, ernannt werden.

Die derzeitigen Mitglieder des Ausschusses sind Walter Berman, William Turner und Karen Wilson-Thissen. Sitzungen finden in der Regel im Januar, März, Juni, September und Dezember statt. Der Head of Reward, EMEA and APAC fungiert als Sekretär des Ausschusses. Der Ausschuss kann bei Bedarf einen Mitarbeiter oder funktionellen Spezialisten der Muttergesellschaft zu einer Sitzung einladen, um es sich zu ermöglichen, seine Aufgaben ordnungsgemäß zu erfüllen. Zu diesen gehört es sicherzustellen, dass die Vergütung im Einklang mit dem effektiven Risikomanagement steht und nicht das Eingehen übermäßiger Risiken fördert.

## Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

### 2. Festlegung von Pools zur erfolgsorientierten Vergütung

Der Manager traf seine jährlichen Total Incentive Award-Entscheidungen aus separaten Pools, die das Immobiliengeschäft, die Vertriebseinheit, das Investmentgeschäft und die Support-Funktionen abdecken und zu Governance- und Aufsichtszwecken auf der regionalen EMEA-Ebene zusammengefasst wurden. Diese Pools werden im Ermessen der Gesellschaft festgelegt, vorbehaltlich der endgültigen Beaufsichtigung und Zustimmung des Vergütungsausschusses. Die Pools für Special Incentive Plans (die „SIPs“) für die Geschäftsbereiche Immobilien, Vertrieb und Investments werden unter Bezugnahme auf vier ungewichtete Faktoren festgelegt: eine „Top-Down“-Beurteilung der Marktgepflogenheiten, der rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Auflagen und anderer interner oder externer kontextueller Faktoren; eine „Bottom-Up“-Berechnung, die auf der Geschäftsleistung im Vergleich zur Plan- und Zielleistungsprämienebene des Unternehmens basiert (siehe „Leistungsbezogene Bezahlung“ weiter unten); die allgemeine finanzielle und strategische Leistung der Gruppe; und die finanzielle und strategische Leistung von Ameriprise Financial als Muttergesellschaft und Anteilinhaber der Gruppe. Die Mittel für unterstützende Funktionen sind Teil des globalen „AIA“-Plans, wobei die Mittel für die einzelnen Regionen und Geschäftsbereiche durch eine umfassende ausgewogene Beurteilung der Geschäftsbereiche im Kontext der Gesamtpformance der Ameriprise Financial Group bestimmt werden. Alle Pools werden zu dem im Laufe des Jahres aufrechterhaltenen Risiko- und Kontrollumfeld in Bezug gesetzt und können von oben nach unten angepasst werden, um diesbezüglich bedeutenden Aspekten Rechnung zu tragen. Der Ausschuss erhält während des gesamten Jahres zudem fortlaufend Berichte von der Risiko-Funktion bezüglich Risikobeurteilungen und allen Themen oder Bereichen, die mit dem Risikoccontrolling oder risikobezogenen Verhaltensbedenken in Zusammenhang stehen.

Der Ausschuss berücksichtigt alle diese Faktoren, um eine ausgewogene Entscheidung bezüglich seiner Beaufsichtigung und Genehmigung des Total Incentive-Pools für das betreffende Jahr zu treffen.

### 3. Festlegung individueller Total Incentive Awards

Individuelle Vergütungsentscheidungen im Rahmen aller Leistungsprämienpläne sind vollständig diskretionär, wenn auch stark beeinflusst von der jährlichen Leistungsbeurteilung und von bekannten Vergütungsniveaus des Marktes für vergleichbare Tätigkeiten sowie von den im Pool verfügbaren Mitteln. Der Bereich Risiko und Compliance stellt einen wichtigen Faktor für die endgültige Leistungsbewertung dar und stellt sicher, dass sich Bedenken in Bezug auf das Risiko- und anderes relevantes Verhalten in den Leistungsbeurteilungen und folglich in den Vergütungsempfehlungen widerspiegeln. Die Leiter des Bereichs Risiko und Compliance für die EMEA-Region berichten zudem direkt an den Vergütungsausschuss für den Leistungsprämienprozess, um sicherzustellen, dass der Ausschuss einen direkten Bericht erhält, auf dessen Grundlage er seine endgültigen Risikoanpassungsentscheidungen treffen kann.

Grundgehälter werden auf einem wettbewerbsfähigen Niveau gehalten, um sicherzustellen, dass es bei Bedarf möglich ist, keine Leistungsprämien zu gewähren.

#### Leistungsbezogene Bezahlung

Das Bottom-up-Element des Entscheidungsprozesses für den SIP-Pool misst die Team- und breitere Geschäftsleistung anhand wichtiger Geschäftsziele für jeden Bereich der Gruppe, darunter die längerfristige Anlagenperformance der Geschäftsbereiche Investments und Immobilien und ein Mix aus Brutto- und Nettoumsätzen des Geschäftsbereichs Vertrieb. Die Anlagenperformance wird anhand der Benchmarks und des Risikoprofils jedes Fonds beurteilt. Alle Auswirkungen dieser Beurteilungen auf die Bottom-up-Berechnung werden gedeckelt und über längere Zeiträume stärker gewichtet, damit Manager nicht dazu angeregt werden, übermäßige Risiken einzugehen, um die Pools für Leistungsprämien aufzustocken. Zwar sind die finanziellen und strategischen Ergebnisse der Gruppe und der Muttergesellschaft wichtige Faktoren für die Festlegung der Pools, das Modell ist aber so aufgebaut, dass sichergestellt ist, dass die Kernziele des Unternehmens, darunter die Erzielung der Anlagenperformance für seine Kunden, ein ausdrücklicher und signifikanter Treiber für die Pool-Festlegung in diesen Geschäftsbereichen sind.

Einzelne diskretionäre Prämien aus den verfügbaren Mitteln werden im Kontext wettbewerbsfähiger Leistungsprämienniveaus für die betreffende Tätigkeit stark von den Bewertungen der einzelnen Person anhand der Ziele und Führungserwartungen der Gruppe (unserer Werte) bestimmt, die jeweils separat auf einer 5-Punkte-Skala bewertet werden, um sicherzustellen, dass der Verhaltensbeurteilung die gebührende Bedeutung zukommt. Die Ziele konzentrieren sich auf die wichtigsten Ergebnisse für die Rolle in diesem Jahr, insbesondere auf die Erzielung von Anlagenperformance für Mitarbeiter des Investment- und des Immobilienbereichs: Alle Mitarbeiter werden auch im Hinblick auf ein obligatorisches Risikomanagement-Ziel verwaltet. Die Anlagenperformance, sofern für die Rolle relevant, wird anhand der Benchmark und des Risikoprofils jedes Fonds bewertet.

Bewertungen werden über das gesamte Unternehmen hinweg auf ihre Kohärenz geprüft, wobei die Leiter des Bereichs Risiko und Compliance für die Region EMEA nach Bedarf Beiträge leisten, um Ausgewogenheit und die gebührende Beachtung des Risikomanagements sicherzustellen. Für Verkaufs-, Immobilien- und Investitionsanreize gibt es keine vordefinierten Raster oder formelbasierten Prämien, die freiwillig sind, um alle relevanten Faktoren berücksichtigen und widerspiegeln zu können.

## Informationen für Anteilinhaber (ungeprüft)

(Fortsetzung)

### *Gewährung von Total Incentive Awards*

Threadneedle glaubt, dass aufgeschobene Leistungsprämien für Höherverdienende und Risikoträger eine Frage guter Praxis sind und einen wichtigen Teil bei der Ausrichtung der Interessen wichtiger Mitarbeiter an den langfristigen Interessen von Kunden und Anteilinhabern darstellen. In diesem Sinne können Total Incentive Awards für alle Mitarbeiter der Gruppe teilweise in Form von aufgeschobenen Prämien über das Programm Ameriprise Financial Long-Term Incentive Award („LTIA“) gewährt werden, und für dem Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter/identifizierte Mitarbeiter sowie Mitarbeiter im Geschäftsbereich Investments durch ein Mittelaufschubprogramm. Aufgeschobene Zahlungen und die Gewährung von Prämien in Form von Instrumenten erfüllen die jeweils geltenden aufsichtsrechtlichen Auflagen.

Mitarbeiter, die die Anforderungen des Vergütungscode erfüllen, bzw. identifizierte Mitarbeiter und jene, die eine vergleichbare Stellung innehaben, unterliegen einem größeren Aufschub. 50 % der gesamten Anreizprämien werden in Form von fondsgebundenen Anteilen gewährt, die nach ihrer Gewährung einer Haltedauer unterliegen. Die fondsgebundenen Anteile sollen die Performance eines Querschnitts von Produkten und Anlageklassen innerhalb der Region widerspiegeln.

### *4. Identifizierte Mitarbeiter*

Dem Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter und identifizierte Mitarbeiter sind eingestuft als oberes Management, Personen mit wesentlichen Auswirkungen auf das Risikoprofil von OGAW, Personen innerhalb von Kontrollfunktionen und andere Mitarbeiter, deren Gesamtvergütung im selben Rahmen wie die von Angehörigen des oberen Managements und von Risikoträgern liegt, deren berufliche Aktivitäten wesentliche Auswirkungen auf die Risikoprofile des Managers oder die von ihm verwalteten Fonds haben. In der Praxis umfassen diese die genannten Fondsmanager der Fonds des Managers.

### *5. Offenlegung der Vergütungszahlung*

Der Performance-Zeitraum für die Vergütung beruht auf dem Kalenderjahr.

Die von der Verwaltungsgesellschaft an 23 dem OGAW-V-Vergütungscode unterliegende Senior Manager im Hinblick auf ihre OGAW-Aktivitäten im Performance-Zeitraum 2021 gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 1,78 Mio. GBP, wovon 0,72 Mio. GBP auf feste und 1,06 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen. Die an andere dem OGAW-Vergütungscode unterliegende Mitarbeiter, deren Handlungen wesentliche Auswirkungen auf das Risikoprofil des Managers hatten, gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 7,17 Mio. GBP, wovon 2,60 Mio. GBP auf feste und 4,57 Mio. GBP auf variable Vergütung entfielen. Die an beauftragte Verwalter von als OGAW regulierten Fonds gezahlte Gesamtvergütung belief sich auf 1,49 Mio. GBP, davon waren 0,25 Mio. GBP feste und 1,24 Mio. GBP variable Komponenten.



## **Informationen für Anleger in der Schweiz (ungeprüft)**

Der geprüfte Jahresbericht und Jahresabschluss, der ungeprüfte Halbjahresbericht, der Bericht über die Veränderungen des Portfoliobestands in dem Jahr, die Satzung, der Verkaufsprospekt (Schweizer Version) und die KIID können auf Anfrage kostenlos bei den Geschäftsstellen der Vertretung und Zahlstelle der SICAV in der Schweiz, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, Succursale de Zurich Bleicherweg 7, CH8027 Zürich, Schweiz, oder am eingetragenen Firmensitz der SICAV angefordert werden.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit gibt keinen Aufschluss über die aktuelle oder zukünftige Wertentwicklung, und bei den Daten zur Wertentwicklung sind Provisionen und Kosten im Rahmen der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b>								
AEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,48 %	8,26 %	9,67 %	12,51 %	9,06 %
AEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,49 %	8,26 %	9,71 %	12,51 %	9,09 %
AKH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,26 %	8,26 %	9,87 %	12,51 %	9,31 %
ANH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-0,79 %	-1,75 %	8,26 %	10,06 %	1,13 %	0,68 %
AU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %	12,51 %	12,32 %
AUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,57 %	8,26 %	11,36 %	12,51 %	12,33 %
DEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-3,21 %	8,26 %	8,90 %	12,51 %	8,07 %
DEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-3,22 %	8,26 %	8,85 %	12,51 %	8,27 %
DU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %	12,51 %	11,46 %
DUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,30 %	8,26 %	10,53 %	12,51 %	11,32 %
IEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,92 %	12,51 %	9,21 %
IEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,29 %	8,26 %	9,86 %	12,51 %	9,25 %
IEP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	6,08 %	8,26 %	2,20 %	12,51 %	14,56 %
IGC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,63 %	8,26 %	10,24 %	12,51 %	10,47 %
IGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,61 %	8,26 %	10,25 %	12,51 %	10,55 %
IKH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,95 %	8,26 %	10,10 %	12,51 %	9,40 %
INH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-0,79 %	-1,47 %	8,26 %	10,39 %	1,13 %	0,79 %
IU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,58 %	12,51 %	12,52 %
IUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,37 %	8,26 %	11,61 %	12,51 %	12,74 %
NEC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,09 %	8,26 %	10,16 %	12,51 %	9,47 %
NEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,10 %	8,26 %	10,08 %	12,51 %	9,54 %
NGC	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,51 %	12,51 %	10,87 %
NGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,41 %	8,26 %	10,49 %	12,51 %	10,84 %
NU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,80 %	12,51 %	12,80 %
NUP	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,17 %	8,26 %	11,82 %	12,51 %	12,80 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
XEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-0,79 %	-1,80 %	2,18 %	2,27 %	k. A.	k. A.
XFH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-0,79 %	-2,07 %	2,18 %	2,21 %	k. A.	k. A.
XGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 17. Mai 2019	-0,79 %	-1,11 %	8,26 %	10,81 %	6,56 %	5,91 %
XU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-0,79 %	-0,87 %	2,18 %	2,48 %	k. A.	k. A.
ZEH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-2,23 %	8,26 %	9,97 %	12,51 %	9,30 %
ZFH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-0,79 %	-2,66 %	2,17 %	2,11 %	k. A.	k. A.
ZGH	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,55 %	8,26 %	10,32 %	12,51 %	10,67 %
ZU	Bloomberg Global Aggregate Corporates - USD Hedged		-0,79 %	-1,32 %	8,26 %	11,63 %	12,51 %	12,60 %
<b>Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond</b>								
AE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,81 %	2,73 %	3,76 %	6,29 %	5,91 %
ANH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,48 %	0,00 %	0,30 %
IE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,22 %	2,73 %	4,39 %	6,29 %	6,46 %
IEP	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2021	-0,66 %	-0,97 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
INH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-1,08 %	-0,51 %	2,73 %	5,04 %	0,00 %	0,41 %
XE	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-1,08 %	-0,73 %	1,13 %	1,53 %	k. A.	k. A.
XFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-1,08 %	-1,05 %	1,13 %	1,48 %	k. A.	k. A.
XGH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-1,08 %	-0,20 %	1,13 %	1,65 %	k. A.	k. A.
XUH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. Oktober 2020	-1,08 %	-0,04 %	1,13 %	1,72 %	k. A.	k. A.
ZE	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,45 %	2,73 %	4,29 %	6,29 %	6,33 %
ZFH	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-1,08 %	-1,72 %	1,27 %	1,51 %	k. A.	k. A.
1E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,80 %	2,73 %	3,78 %	6,29 %	5,91 %
1G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-7,89 %	2,73 %	9,62 %	6,29 %	-0,43 %
2E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,20 %	2,73 %	4,41 %	6,29 %	6,53 %
2G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %	6,29 %	0,55 %
3G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-7,43 %	2,73 %	10,18 %	6,29 %	0,15 %
4E	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-1,08 %	-0,70 %	9,46 %	10,73 %	k. A.	k. A.
4G	iBoxx EUR Corporate Bond	Wertentwicklung seit Auflegung am 4. April 2019	-1,08 %	-6,86 %	2,73 %	10,85 %	2,82 %	2,95 %
8E	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-1,24 %	2,73 %	4,37 %	6,29 %	6,75 %
8G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-7,36 %	2,73 %	10,26 %	6,29 %	0,21 %
9G	iBoxx EUR Corporate Bond		-1,08 %	-7,46 %	2,73 %	10,22 %	6,29 %	0,48 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

**Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)**

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
AE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Mai 2020	3,25 %	1,46 %	14,26 %	11,30 %	k. A.	k. A.
AKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	3,25 %	1,67 %	2,82 %	2,71 %	2,12 %	1,32 %
ANH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	3,25 %	2,17 %	2,82 %	2,68 %	2,12 %	1,71 %
IE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %	10,95 %	9,68 %
IEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,27 %	2,82 %	3,43 %	10,95 %	9,53 %
IKH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	3,25 %	2,48 %	2,82 %	3,32 %	2,12 %	1,42 %
INH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	3,25 %	2,93 %	2,82 %	3,36 %	2,12 %	1,85 %
XE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	3,25 %	3,00 %	2,82 %	4,15 %	2,73 %	2,65 %
ZE	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,38 %	10,95 %	9,67 %
ZEP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,22 %	2,82 %	3,36 %	10,95 %	9,49 %
1E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %	10,95 %	9,13 %
1EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	1,73 %	2,82 %	2,88 %	10,95 %	9,11 %
1G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-4,58 %	2,82 %	8,68 %	10,95 %	3,09 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-4,56 %	2,82 %	8,65 %	10,95 %	3,07 %
1UT	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,47 %	2,82 %	4,25 %	10,95 %	12,25 %
2E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,30 %	2,82 %	3,46 %	10,95 %	9,71 %
2EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,33 %	2,82 %	3,50 %	10,95 %	9,74 %
2FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	1,99 %	2,82 %	3,12 %	10,95 %	9,26 %
2G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-4,11 %	2,82 %	9,29 %	10,95 %	3,71 %
2GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,36 %	10,95 %	3,68 %
3E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %	10,95 %	9,82 %
3EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,35 %	2,82 %	3,51 %	10,95 %	9,80 %
3FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,03 %	2,82 %	3,16 %	10,95 %	9,36 %
3FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,04 %	2,82 %	3,18 %	10,95 %	9,32 %
3G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,99 %	2,82 %	9,35 %	10,95 %	3,62 %
3GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,98 %	2,82 %	9,32 %	10,95 %	3,68 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

**Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)**

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
4E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	3,07 %	2,82 %	4,24 %	10,95 %	10,61 %
4G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,32 %	2,82 %	10,12 %	10,95 %	4,40 %
8E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %	10,95 %	9,76 %
8EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,26 %	2,82 %	3,42 %	10,95 %	9,66 %
8FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	1,95 %	2,82 %	3,09 %	10,95 %	9,28 %
8G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-4,08 %	2,82 %	9,25 %	10,95 %	3,60 %
8GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-4,06 %	2,82 %	9,22 %	10,95 %	3,57 %
9E	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %	10,95 %	9,84 %
9EP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,40 %	2,82 %	3,55 %	10,95 %	9,85 %
9FC	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,10 %	2,82 %	3,19 %	10,95 %	9,32 %
9FH	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	2,08 %	2,82 %	3,22 %	10,95 %	9,30 %
9G	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,87 %	2,82 %	9,44 %	10,95 %	3,69 %
9GP	ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials (Hedged to Euro)		3,25 %	-3,88 %	2,82 %	9,41 %	10,95 %	3,64 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond</b>								
AE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	1,82 %	0,62 %	1,31 %	1,65 %	1,21 %
AEP	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	1,82 %	0,62 %	1,31 %	1,65 %	1,21 %
AKH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,11 %	0,62 %	1,43 %	1,65 %	1,27 %
ANH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,55 %	0,62 %	1,64 %	1,65 %	2,08 %
IE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,23 %	0,62 %	1,72 %	1,65 %	1,39 %
IEP	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,22 %	0,62 %	1,67 %	1,65 %	1,38 %
IGC	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,80 %	0,62 %	2,11 %	1,65 %	1,87 %
IGH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,76 %	0,62 %	2,04 %	1,65 %	1,90 %
IKH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	k. A.	2,49 %	0,62 %	1,82 %	1,63 %	0,94 %
INH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	k. A.	2,92 %	0,62 %	2,02 %	1,63 %	1,34 %
XE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,64 %	0,62 %	2,13 %	1,65 %	1,58 %
XGC	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. November 2019	k. A.	3,19 %	0,62 %	2,48 %	0,95 %	0,76 %
XGH	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	3,17 %	0,62 %	2,52 %	1,65 %	2,04 %
ZE	KEIN OFFIZIELLER VERGLEICH SINDE	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Juli 2019	k. A.	2,16 %	0,62 %	1,66 %	1,65 %	1,38 %
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
AE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %	k. A.	k. A.
AEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	-1,46 %	-2,38 %	1,52 %	1,36 %	k. A.	k. A.
AFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-1,19 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-1,46 %	-1,93 %	1,04 %	1,03 %	k. A.	k. A.
ANH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2020	-1,46 %	-1,46 %	1,04 %	1,12 %	k. A.	k. A.
ASC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,43 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ASH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,44 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
AUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,36 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,33 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ID	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. November 2019	-1,46 %	-2,31 %	2,74 %	2,77 %	-0,19 %	-0,20 %
IE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %	5,72 %	5,82 %
IEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,16 %	5,72 %	5,82 %
IFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,56 %	2,74 %	2,78 %	5,72 %	5,27 %
IGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,45 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IKH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. August 2019	-1,46 %	-1,88 %	2,74 %	3,33 %	-1,01 %	-1,03 %
INH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-1,46 %	-1,41 %	2,74 %	3,69 %	-0,26 %	0,02 %
ISC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,42 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ISH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,42 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IUC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,35 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	-0,62 %	-0,26 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
LE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,24 %	2,74 %	3,23 %	5,72 %	5,98 %
NEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. März 2019	-1,46 %	-2,23 %	2,74 %	3,23 %	3,60 %	3,91 %
ZD	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. November 2019	-1,46 %	-2,36 %	2,74 %	2,71 %	-0,19 %	-0,22 %
ZE	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %	5,72 %	5,73 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.



## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European Social Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZEP	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. April 2019	-1,46 %	-2,28 %	2,74 %	3,11 %	2,60 %	2,59 %
ZFH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)		-1,46 %	-2,60 %	2,74 %	2,76 %	5,72 %	5,32 %
ZGC	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 3. April 2020	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,77 %	k. A.	k. A.
ZGH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 3. April 2020	-1,46 %	-1,75 %	7,68 %	7,78 %	k. A.	k. A.
ZUH	ICE BofA Euro Non-Sovereign (50%), ICE BofA Euro Corp Euroland Issuers (50%)	Wertentwicklung seit Auflegung am 12. Juni 2020	-1,46 %	-1,58 %	3,50 %	3,92 %	k. A.	k. A.
<b>Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond</b>								
AE	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %	7,00 %	6,73 %
AEP	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-0,63 %	2,23 %	5,38 %	7,00 %	6,78 %
AKH	ICE BofA Custom Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. August 2019	0,86 %	-0,54 %	2,23 %	5,56 %	0,89 %	0,83 %
ANH	ICE BofA Custom Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	0,86 %	-0,13 %	2,23 %	5,97 %	0,73 %	0,87 %
AUH	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-0,02 %	2,23 %	6,72 %	7,00 %	9,78 %
DE	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %	7,00 %	6,17 %
DEP	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-1,18 %	2,23 %	4,80 %	7,00 %	6,12 %
DUH	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-0,65 %	2,23 %	6,04 %	7,00 %	9,00 %
IE	ICE BofA Custom Index		0,86 %	-0,04 %	2,23 %	6,01 %	7,00 %	7,38 %
INH	ICE BofA Custom Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	0,86 %	0,70 %	2,23 %	6,77 %	0,73 %	1,02 %
ZE	ICE BofA Custom Index	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-0,42 %	-0,40 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>								
AEC	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-2,47 %	7,13 %	6,21 %	13,09 %	8,77 %
AEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-2,43 %	7,13 %	6,22 %	13,09 %	8,77 %
AKH	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	0,91 %	-2,12 %	7,13 %	6,31 %	4,19 %	2,30 %
ANH	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	0,91 %	-1,71 %	7,13 %	6,15 %	4,19 %	3,25 %
ASH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,60 %	7,13 %	7,35 %	13,09 %	11,18 %
AU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %	13,09 %	12,10 %
AUP	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,54 %	7,13 %	7,90 %	13,09 %	12,15 %
DEC	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-2,57 %	7,13 %	6,10 %	13,09 %	8,61 %
DEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-2,53 %	7,13 %	6,12 %	13,09 %	8,62 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,64 %	7,13 %	7,79 %	13,09 %	11,97 %
IEC	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit der Auflegung am 25. Februar 2021	k. A.	-1,16 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,65 %	7,13 %	7,09 %	13,09 %	9,63 %
IU	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-0,77 %	7,13 %	8,76 %	13,09 %	12,88 %
W	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-1,20 %	7,13 %	8,27 %	13,09 %	12,52 %
WEH	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	-2,10 %	7,13 %	6,59 %	13,09 %	9,13 %
XUP	JPM CEMBI Broad Diversified		0,91 %	0,07 %	7,13 %	9,66 %	13,09 %	13,86 %
ZU	JPM CEMBI Broad Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	k. A.	0,01 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt</b>								
AEC	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,92 %	5,88 %	5,56 %	14,42 %	9,61 %
AEH	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,91 %	5,88 %	5,55 %	14,42 %	9,68 %
AKH	JPM EMBI Global	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	-1,51 %	-3,83 %	5,88 %	5,36 %	3,58 %	0,97 %
ANH	JPM EMBI Global	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	-1,51 %	-3,40 %	5,88 %	4,87 %	3,58 %	1,90 %
ASH	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,08 %	5,88 %	6,61 %	14,42 %	12,16 %
AU	JPM EMBI Global		-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %	14,42 %	13,04 %
AUP	JPM EMBI Global		-1,51 %	-2,96 %	5,88 %	7,29 %	14,42 %	13,06 %
DEH	JPM EMBI Global		-1,51 %	-4,02 %	5,88 %	5,44 %	14,42 %	9,54 %
DU	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,06 %	5,88 %	7,18 %	14,42 %	12,93 %
IEH	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,16 %	5,88 %	6,41 %	14,42 %	10,50 %
IU	JPM EMBI Global	Wertentwicklung seit Auflegung am 22. Mai 2019	-1,51 %	-2,45 %	5,88 %	7,98 %	7,09 %	5,79 %
SU	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,12 %	14,42 %	12,89 %
SUP	JPM EMBI Global		-1,51 %	-3,11 %	5,88 %	7,13 %	14,42 %	12,84 %
W	JPM EMBI Global		-1,51 %	-2,62 %	5,88 %	7,66 %	14,42 %	13,43 %
XUP	JPM EMBI Global		-1,51 %	-1,59 %	5,88 %	8,91 %	14,42 %	14,79 %
ZU	JPM EMBI Global		-1,51 %	-2,34 %	5,88 %	8,07 %	14,42 %	13,89 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
AEC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-2,58 %	4,79 %	2,68 %	10,54 %	3,91 %
AEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-2,59 %	4,79 %	2,69 %	10,54 %	4,01 %
AKH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	0,19 %	-2,33 %	4,79 %	2,65 %	2,70 %	-0,66 %
ANH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	0,19 %	-1,88 %	4,79 %	2,90 %	2,70 %	0,24 %
ASC	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,70 %	4,79 %	3,71 %	10,54 %	6,34 %
ASH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,72 %	4,79 %	3,70 %	10,54 %	6,36 %
AU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %	10,54 %	7,23 %
AUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,65 %	4,79 %	4,22 %	10,54 %	7,20 %
DEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-2,73 %	4,79 %	2,54 %	10,54 %	3,81 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,79 %	4,79 %	4,07 %	10,54 %	6,99 %
IE	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. November 2019	0,19 %	6,62 %	4,79 %	-3,68 %	1,34 %	-0,83 %
IEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,84 %	4,79 %	3,45 %	10,54 %	4,74 %
XU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %	10,54 %	8,79 %
XUP	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-0,21 %	4,79 %	5,75 %	10,54 %	8,80 %
ZEH	JPM EMBI Global 3-5 Yrs		0,19 %	-1,90 %	4,79 %	3,38 %	10,54 %	4,67 %
ZU	JPM EMBI Global 3-5 Yrs	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-1,11 %	-0,74 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>								
AEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	2,57 %	6,10 %	3,32 %	14,40 %	11,89 %
AEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	2,56 %	6,10 %	3,33 %	14,40 %	11,92 %
AKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	5,27 %	2,89 %	6,10 %	3,11 %	2,44 %	1,64 %
ANH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	5,27 %	3,26 %	6,10 %	2,96 %	2,44 %	2,02 %
ASH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,45 %	6,10 %	4,30 %	14,40 %	14,49 %
AU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %	14,40 %	15,38 %
AUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,54 %	6,10 %	4,99 %	14,40 %	15,41 %
DEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	2,37 %	6,10 %	3,13 %	14,40 %	11,72 %
DEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	2,38 %	6,10 %	3,13 %	14,40 %	11,69 %
DU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,34 %	6,10 %	4,78 %	14,40 %	15,14 %
IEC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,30 %	14,40 %	12,84 %
IEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,49 %	6,10 %	4,22 %	14,40 %	12,93 %
IKH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	5,27 %	3,80 %	6,10 %	4,08 %	2,44 %	1,84 %
INH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	5,27 %	4,19 %	6,10 %	3,97 %	2,44 %	2,25 %
ISC	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained	Wertentwicklung seit Auflegung am 29. Juli 2021	1,38 %	1,52 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	4,48 %	6,10 %	5,94 %	14,40 %	16,46 %
TEH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,48 %	6,10 %	4,22 %	14,40 %	13,04 %
XUP	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	5,06 %	6,10 %	6,51 %	14,40 %	16,98 %
ZFH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	2,91 %	6,10 %	3,70 %	14,40 %	12,03 %
ZGH	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	3,79 %	6,10 %	4,13 %	14,40 %	13,94 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZU	ICE BofA US High Yield Cash Pay Constrained		5,27 %	4,22 %	6,10 %	5,67 %	14,40 %	16,15 %
<b>Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond</b>								
AEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	-0,82 %	5,67 %	2,44 %	14,12 %	11,69 %
AKH	JPM Asia Credit Diversified	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. August 2019	-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	2,68 %	3,14 %	1,89 %
AS	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	2,06 %	5,67 %	2,32 %	14,12 %	13,55 %
ASC	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,03 %	5,67 %	3,65 %	14,12 %	14,19 %
ASH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,01 %	5,67 %	3,61 %	14,12 %	14,13 %
AU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %	14,12 %	15,13 %
AUP	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,07 %	5,67 %	4,10 %	14,12 %	15,16 %
AVC	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	-0,50 %	5,67 %	3,16 %	14,12 %	13,66 %
AVH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	-0,38 %	5,67 %	3,10 %	14,12 %	13,62 %
DEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	-1,14 %	5,67 %	2,21 %	14,12 %	11,43 %
IEH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	-0,24 %	5,67 %	3,15 %	14,12 %	12,51 %
IGH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,41 %	5,67 %	3,60 %	14,12 %	13,86 %
ISH	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,66 %	5,67 %	4,34 %	14,12 %	14,96 %
IU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,67 %	5,67 %	4,80 %	14,12 %	16,01 %
XU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	1,07 %	5,67 %	5,46 %	14,12 %	16,69 %
ZU	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,57 %	5,67 %	4,70 %	14,12 %	15,86 %
ZUP	JPM Asia Credit Diversified		-0,61 %	0,55 %	5,67 %	4,63 %	14,12 %	15,71 %
<b>Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return</b>								
AE	MUICP (EU CPI)		4,76 %	6,86 %	-0,25 %	5,21 %	1,33 %	12,23 %
AEP	MUICP (EU CPI)		4,76 %	6,81 %	-0,25 %	5,16 %	1,33 %	12,19 %
DE	MUICP (EU CPI)		4,76 %	6,06 %	-0,25 %	4,43 %	1,33 %	11,42 %
IE	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,95 %	1,33 %	12,97 %
IEP	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,61 %	-0,25 %	5,92 %	1,33 %	13,04 %
LE	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,77 %	-0,25 %	6,11 %	1,33 %	13,14 %
LEP	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,82 %	-0,25 %	6,10 %	1,33 %	13,20 %
ZE	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,41 %	-0,25 %	5,74 %	1,33 %	12,82 %
ZEP	MUICP (EU CPI)		4,76 %	7,42 %	-0,25 %	5,75 %	1,33 %	12,78 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return</b>								
AEC	US CPI		7,12 %	-0,68 %	k. A.	9,60 %	k. A.	8,90 %
AEH	US CPI		7,12 %	-0,67 %	k. A.	9,60 %	k. A.	8,90 %
AKH	US CPI	Wertentwicklung seit Auflegung am 13. August 2019	7,12 %	-0,44 %	k. A.	9,59 %	k. A.	3,22 %
AU	US CPI		7,12 %	0,32 %	k. A.	11,46 %	k. A.	12,28 %
AUP	US CPI		7,12 %	0,32 %	k. A.	11,46 %	k. A.	12,30 %
DEH	US CPI		7,12 %	-1,32 %	k. A.	8,89 %	k. A.	8,19 %
DU	US CPI		7,12 %	-0,33 %	k. A.	10,74 %	k. A.	11,55 %
IEH	US CPI	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	7,12 %	-0,09 %	k. A.	10,26 %	k. A.	2,91 %
IGH	US CPI		7,12 %	0,66 %	k. A.	10,78 %	k. A.	10,85 %
IU	US CPI		7,12 %	1,03 %	k. A.	12,24 %	k. A.	13,08 %
W	US CPI		7,12 %	0,22 %	k. A.	11,35 %	k. A.	12,15 %
ZU	US CPI	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	0,99 %	-1,89 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income</b>								
AE	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %	2,39 %	16,37 %
AEC	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,43 %	0,66 %	0,64 %	2,39 %	10,88 %
AEH	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,35 %	0,66 %	0,61 %	2,39 %	10,90 %
AEP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	15,61 %	0,66 %	-6,12 %	2,39 %	16,38 %
AS	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	9,39 %	0,66 %	0,33 %	2,39 %	12,44 %
ASC	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,33 %	0,66 %	1,53 %	2,39 %	13,35 %
ASH	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,27 %	0,66 %	1,46 %	2,39 %	13,35 %
ASP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	9,60 %	0,66 %	0,57 %	2,39 %	12,74 %
AU	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %	2,39 %	14,27 %
AUM	Zusammengesetzte Benchmark	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. September 2019	1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,32 %	0,63 %	4,50 %
AUP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,45 %	0,66 %	2,33 %	2,39 %	14,30 %
DEC	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	5,63 %	0,66 %	-0,14 %	2,39 %	9,99 %
DEH	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	5,55 %	0,66 %	-0,14 %	2,39 %	10,11 %
DEP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	14,74 %	0,66 %	-6,82 %	2,39 %	15,56 %
DU	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %	2,39 %	13,45 %
DUP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,65 %	0,66 %	1,56 %	2,39 %	13,50 %
ZE	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	16,17 %	0,66 %	-5,65 %	2,39 %	17,04 %
ZEC	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,93 %	0,66 %	1,08 %	2,39 %	11,39 %
ZEH	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,91 %	0,66 %	1,11 %	2,39 %	11,40 %
ZFH	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	6,59 %	0,66 %	0,89 %	2,39 %	10,95 %
ZU	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,98 %	0,66 %	2,84 %	2,39 %	14,90 %
ZUP	Zusammengesetzte Benchmark		1,03 %	7,90 %	0,66 %	2,72 %	2,39 %	14,79 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities</b>								
AE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-2,97 %	20,31 %	24,15 %	k. A.	k. A.
AEC	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-10,90 %	20,31 %	29,65 %	k. A.	k. A.
AEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-10,94 %	20,31 %	29,65 %	k. A.	k. A.
AU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-9,83 %	20,31 %	30,12 %	k. A.	k. A.
AUP	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-9,84 %	20,31 %	30,12 %	k. A.	k. A.
IE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-2,10 %	20,31 %	24,47 %	k. A.	k. A.
IEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-10,11 %	20,31 %	29,96 %	k. A.	k. A.
IG	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-8,13 %	20,31 %	21,79 %	k. A.	k. A.
IU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-8,98 %	20,31 %	30,48 %	k. A.	k. A.
LE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-1,75 %	20,31 %	24,58 %	k. A.	k. A.
LG	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-7,89 %	20,31 %	21,90 %	k. A.	k. A.
XU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-8,41 %	20,31 %	30,71 %	k. A.	k. A.
ZE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-2,23 %	20,31 %	24,40 %	k. A.	k. A.
ZEC	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-10,21 %	20,31 %	29,89 %	k. A.	k. A.
ZEH	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-10,24 %	20,31 %	29,89 %	k. A.	k. A.
ZU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,39 %	k. A.	k. A.
ZUP	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 24. September 2020	-2,22 %	-9,18 %	20,31 %	30,38 %	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilsklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Focus</b>								
AEH	MSCI AC World		19,04 %	21,21 %	16,82 %	24,63 %	27,30 %	29,89 %
AEP	MSCI AC World		19,04 %	31,78 %	16,82 %	16,31 %	27,30 %	36,40 %
AU	MSCI AC World		19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %	27,30 %	33,90 %
AUP	MSCI AC World		19,04 %	22,48 %	16,82 %	26,78 %	27,30 %	33,86 %
DEH	MSCI AC World		19,04 %	20,31 %	16,82 %	23,70 %	27,30 %	28,94 %
DU	MSCI AC World		19,04 %	21,57 %	16,82 %	25,84 %	27,30 %	32,90 %
IE	MSCI AC World		19,04 %	32,91 %	16,82 %	17,30 %	27,30 %	37,49 %
IEH	MSCI AC World		19,04 %	22,24 %	16,82 %	25,69 %	27,30 %	31,69 %
IU	MSCI AC World		19,04 %	23,53 %	16,82 %	27,86 %	27,30 %	35,01 %
IUP	MSCI AC World		19,04 %	23,52 %	16,82 %	27,82 %	27,30 %	34,94 %
W	MSCI AC World		19,04 %	22,54 %	16,82 %	26,85 %	27,30 %	33,96 %
XU	MSCI AC World		19,04 %	24,52 %	16,82 %	28,89 %	27,30 %	36,15 %
ZE	MSCI AC World		19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %	27,30 %	37,44 %
ZEH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. September 2020	19,04 %	22,14 %	12,83 %	9,88 %	k. A.	k. A.
ZEP	MSCI AC World		19,04 %	32,77 %	16,82 %	17,19 %	27,30 %	37,42 %
ZFH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 16. September 2020	19,04 %	21,76 %	12,83 %	9,80 %	k. A.	k. A.
ZG	MSCI AC World		19,04 %	24,54 %	16,82 %	23,79 %	27,30 %	29,72 %
ZU	MSCI AC World		19,04 %	23,40 %	16,82 %	27,74 %	27,30 %	34,91 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities</b>								
AEH	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-10,32 %	18,69 %	31,52 %	18,88 %	26,38 %
AU	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-9,25 %	18,69 %	33,80 %	18,88 %	30,53 %
DEH	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-10,97 %	18,69 %	30,51 %	18,88 %	25,53 %
DU	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-9,93 %	18,69 %	32,80 %	18,88 %	29,55 %
IE	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 6. Mai 2020	-2,22 %	-1,53 %	46,87 %	47,45 %	k. A.	k. A.
IEH	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-9,54 %	18,69 %	32,58 %	18,88 %	27,57 %
IU	MSCI Emerging Markets	Wertentwicklung seit Auflegung am 22. Mai 2019	-2,22 %	-8,48 %	18,69 %	34,94 %	14,81 %	19,39 %
ZU	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-8,57 %	18,69 %	34,80 %	18,88 %	31,40 %
1E	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-2,27 %	18,69 %	22,86 %	18,88 %	32,53 %
1U	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-9,17 %	18,69 %	33,92 %	18,88 %	30,89 %
2E	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-1,68 %	18,69 %	23,61 %	18,88 %	33,89 %
2U	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-8,60 %	18,69 %	34,80 %	18,88 %	31,49 %
8E	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-1,71 %	18,69 %	23,56 %	18,88 %	34,03 %
8U	MSCI Emerging Markets		-2,22 %	-8,65 %	18,69 %	34,69 %	18,88 %	31,50 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>								
AEC	MSCI AC World		19,04 %	14,84 %	16,82 %	1,52 %	27,30 %	18,13 %
AUP	MSCI AC World		19,04 %	16,13 %	16,82 %	3,23 %	27,30 %	21,98 %
DEC	MSCI AC World		19,04 %	14,27 %	16,82 %	0,97 %	27,30 %	17,54 %
DUP	MSCI AC World		19,04 %	15,58 %	16,82 %	2,71 %	27,30 %	21,13 %
IU	MSCI AC World		19,04 %	17,04 %	16,82 %	4,09 %	27,30 %	22,87 %
TE	MSCI AC World		19,04 %	25,75 %	16,82 %	-4,66 %	27,30 %	25,08 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilsklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Equity Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZU	MSCI AC World		19,04 %	16,99 %	16,82 %	4,02 %	27,30 %	22,82 %
1E	MSCI AC World		19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %	27,30 %	24,34 %
1EP	MSCI AC World		19,04 %	25,12 %	16,82 %	-5,14 %	27,30 %	24,27 %
1SC	MSCI AC World		19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,22 %	27,30 %	20,86 %
1SH	MSCI AC World		19,04 %	15,95 %	16,82 %	2,18 %	27,30 %	21,00 %
1ST	MSCI AC World		19,04 %	15,98 %	16,82 %	2,19 %	27,30 %	20,88 %
1U	MSCI AC World		19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %	27,30 %	22,09 %
1UP	MSCI AC World		19,04 %	16,29 %	16,82 %	3,40 %	27,30 %	22,01 %
1VT	MSCI AC World		19,04 %	15,25 %	16,82 %	0,40 %	27,30 %	20,44 %
2E	MSCI AC World		19,04 %	25,88 %	16,82 %	-4,56 %	27,30 %	25,02 %
2EP	MSCI AC World		19,04 %	25,84 %	16,82 %	-4,53 %	27,30 %	25,09 %
2U	MSCI AC World		19,04 %	17,00 %	16,82 %	4,04 %	27,30 %	22,81 %
2UP	MSCI AC World		19,04 %	17,03 %	16,82 %	4,03 %	27,30 %	22,76 %
3E	MSCI AC World		19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,43 %	27,30 %	25,19 %
3EP	MSCI AC World		19,04 %	26,06 %	16,82 %	-4,42 %	27,30 %	25,28 %
3U	MSCI AC World		19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %	27,30 %	23,04 %
3UP	MSCI AC World		19,04 %	17,16 %	16,82 %	4,18 %	27,30 %	22,97 %
8E	MSCI AC World		19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,60 %	27,30 %	25,00 %
8EP	MSCI AC World		19,04 %	25,83 %	16,82 %	-4,63 %	27,30 %	24,97 %
8U	MSCI AC World		19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %	27,30 %	22,76 %
8UP	MSCI AC World		19,04 %	16,95 %	16,82 %	3,99 %	27,30 %	22,71 %
9E	MSCI AC World		19,04 %	26,09 %	16,82 %	-4,33 %	27,30 %	25,36 %
9EP	MSCI AC World		19,04 %	26,10 %	16,82 %	-4,31 %	27,30 %	25,41 %
9U	MSCI AC World		19,04 %	17,22 %	16,82 %	4,33 %	27,30 %	23,25 %
9UP	MSCI AC World		19,04 %	17,31 %	16,82 %	4,27 %	27,30 %	23,19 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Select</b>								
IU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	13,86 %	16,82 %	21,20 %	19,61 %	24,55 %
ZU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	13,80 %	16,82 %	21,08 %	19,61 %	24,48 %
1E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	21,61 %	16,82 %	10,40 %	19,61 %	25,50 %
1U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	13,03 %	16,82 %	20,34 %	19,61 %	23,81 %
2E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	22,39 %	16,82 %	11,10 %	19,61 %	24,60 %
2U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	13,72 %	16,82 %	21,07 %	19,61 %	24,47 %
3U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	13,91 %	16,82 %	21,28 %	19,61 %	24,52 %
8E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	22,31 %	16,82 %	11,03 %	19,61 %	26,25 %
8U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	13,67 %	16,82 %	21,03 %	19,61 %	24,54 %
9U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	13,96 %	16,82 %	21,33 %	19,61 %	24,70 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.



## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies</b>								
AE	MSCI World Small Cap		25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %	29,12 %	38,43 %
AEP	MSCI World Small Cap		25,00 %	22,14 %	6,85 %	27,53 %	29,12 %	38,50 %
AK	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	25,00 %	25,15 %	5,98 %	19,04 %	k. A.	k. A.
AUP	MSCI World Small Cap		25,00 %	13,53 %	6,85 %	39,00 %	29,12 %	35,77 %
DE	MSCI World Small Cap		25,00 %	21,53 %	6,85 %	26,89 %	29,12 %	37,71 %
IE	MSCI World Small Cap		25,00 %	23,19 %	6,85 %	28,62 %	29,12 %	39,61 %
IEP	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 29. Juli 2020	25,00 %	23,19 %	22,69 %	25,47 %	k. A.	k. A.
NE	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 3. Juli 2019	25,00 %	23,43 %	6,85 %	28,88 %	9,42 %	11,22 %
XE	MSCI World Small Cap		25,00 %	24,17 %	6,85 %	29,65 %	29,12 %	40,80 %
XFH	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2020	25,00 %	23,86 %	8,50 %	9,06 %	k. A.	k. A.
XG	MSCI World Small Cap		25,00 %	16,50 %	6,85 %	36,89 %	29,12 %	32,70 %
XGH	MSCI World Small Cap		25,00 %	24,53 %	6,85 %	28,85 %	29,12 %	42,02 %
XU	MSCI World Small Cap	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2020	25,00 %	15,41 %	8,50 %	12,89 %	k. A.	k. A.
ZE	MSCI World Small Cap		25,00 %	23,06 %	6,85 %	28,49 %	29,12 %	39,43 %
ZFH	MSCI World Small Cap		25,00 %	22,60 %	6,85 %	28,16 %	29,12 %	38,92 %
ZG	MSCI World Small Cap		25,00 %	15,43 %	6,85 %	35,73 %	29,12 %	31,71 %
ZGH	MSCI World Small Cap		25,00 %	23,29 %	6,85 %	27,70 %	29,12 %	40,75 %
ZU	MSCI World Small Cap		25,00 %	14,38 %	6,85 %	40,06 %	29,12 %	36,82 %
<b>Threadneedle (Lux) - American</b>								
AEH	S&P 500		28,71 %	23,73 %	18,40 %	18,60 %	31,49 %	27,22 %
AU	S&P 500		28,71 %	24,99 %	18,40 %	20,51 %	31,49 %	31,14 %
DEH	S&P 500		28,71 %	23,30 %	18,40 %	18,17 %	31,49 %	26,76 %
DU	S&P 500		28,71 %	24,56 %	18,40 %	20,08 %	31,49 %	30,66 %
IEH	S&P 500		28,71 %	24,85 %	18,40 %	19,66 %	31,49 %	28,35 %
IU	S&P 500		28,71 %	26,12 %	18,40 %	21,59 %	31,49 %	32,32 %
W	S&P 500		28,71 %	25,37 %	18,40 %	20,87 %	31,49 %	31,53 %
ZE	S&P 500		28,71 %	35,57 %	18,40 %	11,43 %	31,49 %	34,55 %
ZEH	S&P 500		28,71 %	24,73 %	18,40 %	19,56 %	31,49 %	28,20 %
ZU	S&P 500		28,71 %	26,02 %	18,40 %	21,42 %	31,49 %	32,14 %
1E	S&P 500		28,71 %	34,66 %	18,40 %	10,70 %	31,49 %	33,71 %
1EH	S&P 500		28,71 %	23,90 %	18,40 %	18,71 %	31,49 %	27,39 %
1EP	S&P 500		28,71 %	34,65 %	18,40 %	10,70 %	31,49 %	33,72 %
1U	S&P 500		28,71 %	25,15 %	18,40 %	20,66 %	31,49 %	31,25 %
2E	S&P 500		28,71 %	35,48 %	18,40 %	11,37 %	31,49 %	34,59 %
2U	S&P 500		28,71 %	25,92 %	18,40 %	21,40 %	31,49 %	32,09 %
3EH	S&P 500		28,71 %	24,90 %	18,40 %	19,63 %	31,49 %	28,30 %
3U	S&P 500		28,71 %	26,15 %	18,40 %	21,62 %	31,49 %	32,38 %
8E	S&P 500		28,71 %	35,43 %	18,40 %	11,33 %	31,49 %	34,51 %
8U	S&P 500		28,71 %	25,87 %	18,40 %	21,35 %	31,49 %	32,14 %
9EH	S&P 500		28,71 %	24,99 %	18,40 %	19,78 %	31,49 %	28,47 %
9U	S&P 500		28,71 %	26,20 %	18,40 %	21,67 %	31,49 %	32,39 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - American Select</b>								
AD	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	28,71 %	29,73 %	18,40 %	13,52 %	11,87 %	14,46 %
AEH	S&P 500		28,71 %	19,50 %	18,40 %	22,24 %	31,49 %	28,61 %
AN	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	28,71 %	24,30 %	18,40 %	21,04 %	11,87 %	16,73 %
AU	S&P 500		28,71 %	20,68 %	18,40 %	24,22 %	31,49 %	32,67 %
DEH	S&P 500		28,71 %	18,57 %	18,40 %	21,33 %	31,49 %	27,65 %
DU	S&P 500		28,71 %	19,78 %	18,40 %	23,29 %	31,49 %	31,72 %
ID	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	28,71 %	30,76 %	18,40 %	14,42 %	11,87 %	14,90 %
IE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	28,71 %	30,84 %	18,40 %	14,82 %	10,81 %	14,89 %
IEH	S&P 500		28,71 %	20,45 %	18,40 %	23,20 %	31,49 %	29,69 %
IN	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	28,71 %	25,26 %	18,40 %	21,96 %	11,87 %	17,13 %
W	S&P 500		28,71 %	20,74 %	18,40 %	24,28 %	31,49 %	32,76 %
ZEH	S&P 500		28,71 %	20,30 %	18,40 %	23,14 %	31,49 %	29,68 %
ZU	S&P 500		28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %	31,49 %	33,67 %
1E	S&P 500		28,71 %	30,01 %	18,40 %	14,11 %	31,49 %	35,39 %
1EH	S&P 500		28,71 %	19,66 %	18,40 %	22,39 %	31,49 %	28,63 %
1EP	S&P 500		28,71 %	30,00 %	18,40 %	14,11 %	31,49 %	35,33 %
1U	S&P 500		28,71 %	20,83 %	18,40 %	24,38 %	31,49 %	32,98 %
2EH	S&P 500		28,71 %	20,44 %	18,40 %	23,19 %	31,49 %	29,56 %
2U	S&P 500		28,71 %	21,59 %	18,40 %	25,16 %	31,49 %	33,57 %
3E	S&P 500		28,71 %	31,05 %	18,40 %	15,02 %	31,49 %	36,21 %
3U	S&P 500		28,71 %	21,80 %	18,40 %	25,37 %	31,49 %	33,71 %
8EH	S&P 500		28,71 %	20,29 %	18,40 %	23,12 %	31,49 %	29,78 %
8U	S&P 500		28,71 %	21,52 %	18,40 %	25,09 %	31,49 %	33,63 %
9E	S&P 500		28,71 %	31,17 %	18,40 %	15,12 %	31,49 %	36,42 %
9U	S&P 500		28,71 %	21,87 %	18,40 %	25,46 %	31,49 %	34,01 %
<b>Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies</b>								
AEH	Russell 2500		18,18 %	22,12 %	19,99 %	28,44 %	27,77 %	26,00 %
AU	Russell 2500		18,18 %	23,60 %	19,99 %	30,64 %	27,77 %	30,06 %
DEH	Russell 2500		18,18 %	21,51 %	19,99 %	27,81 %	27,77 %	25,40 %
DU	Russell 2500		18,18 %	22,99 %	19,99 %	30,06 %	27,77 %	29,42 %
IE	Russell 2500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	18,18 %	34,11 %	19,99 %	20,86 %	9,14 %	8,53 %
IU	Russell 2500		18,18 %	24,66 %	19,99 %	31,79 %	27,77 %	31,07 %
ZU	Russell 2500		18,18 %	24,54 %	19,99 %	31,71 %	27,77 %	31,12 %
1E	Russell 2500		18,18 %	33,15 %	19,99 %	20,05 %	27,77 %	32,57 %
1EP	Russell 2500		18,18 %	33,14 %	19,99 %	20,06 %	27,77 %	32,70 %
1U	Russell 2500		18,18 %	23,75 %	19,99 %	30,86 %	27,77 %	30,30 %
2U	Russell 2500		18,18 %	24,51 %	19,99 %	31,66 %	27,77 %	30,96 %
3EH	Russell 2500		18,18 %	23,19 %	19,99 %	29,63 %	27,77 %	27,18 %
3U	Russell 2500		18,18 %	24,68 %	19,99 %	31,84 %	27,77 %	31,15 %
8U	Russell 2500		18,18 %	24,46 %	19,99 %	31,61 %	27,77 %	30,96 %
9EH	Russell 2500		18,18 %	23,20 %	19,99 %	29,69 %	27,77 %	27,31 %
9U	Russell 2500		18,18 %	24,73 %	19,99 %	31,89 %	27,77 %	31,25 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity</b>								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-0,40 %	22,75 %	13,91 %	19,48 %	24,85 %
AF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-4,62 %	22,75 %	13,34 %	19,48 %	20,39 %
AS	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-5,58 %	22,75 %	21,97 %	19,48 %	20,69 %
ASH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-7,80 %	22,75 %	22,68 %	19,48 %	21,25 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-7,43 %	22,75 %	24,14 %	19,48 %	22,53 %
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-1,14 %	22,75 %	13,04 %	19,48 %	23,87 %
IF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-3,76 %	22,75 %	14,26 %	19,48 %	21,41 %
ISH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-7,00 %	22,75 %	23,72 %	19,48 %	22,24 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-6,64 %	22,75 %	25,20 %	19,48 %	23,64 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 17. Mai 2019	-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %	10,94 %	12,45 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-5,89 %	22,75 %	26,21 %	19,48 %	24,64 %
ZE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	0,35 %	22,75 %	14,75 %	19,48 %	25,78 %
ZEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-7,83 %	22,75 %	22,88 %	19,48 %	19,64 %
ZF	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-3,87 %	22,75 %	14,21 %	19,48 %	21,33 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-5,85 %	22,75 %	21,19 %	19,48 %	18,76 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-6,73 %	22,75 %	25,08 %	19,48 %	23,46 %
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>								
AE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-8,64 %	-3,78 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-8,64 %	-10,74 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-8,64 %	-4,02 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Juni 2021	-8,64 %	-10,98 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IE	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	-2,65 %	2,96 %	22,75 %	17,53 %	6,89 %	13,26 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %	12,84 %	19,48 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	-2,65 %	-4,40 %	22,75 %	27,99 %	12,84 %	19,41 %
1E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	-2,65 %	2,19 %	22,75 %	16,65 %	12,84 %	20,60 %
1U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	-2,65 %	-5,02 %	22,75 %	27,15 %	12,84 %	18,94 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Asia Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
2E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	-2,65 %	2,82 %	22,75 %	17,36 %	12,84 %	21,27 %
2U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	-2,65 %	-4,44 %	22,75 %	27,93 %	12,84 %	19,43 %
3U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	-2,65 %	-4,31 %	22,75 %	28,11 %	12,84 %	19,53 %
8E	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	-2,65 %	2,78 %	22,75 %	17,25 %	12,84 %	21,04 %
8U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	-2,65 %	-4,48 %	22,75 %	27,88 %	12,84 %	19,43 %
9U	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	-2,65 %	-4,27 %	22,75 %	28,16 %	12,84 %	19,63 %
<b>Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities</b>								
AEC	S&P 500		28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,72 %	31,49 %	26,94 %
AEH	S&P 500		28,71 %	20,75 %	18,40 %	18,55 %	31,49 %	26,93 %
AU	S&P 500		28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %	31,49 %	30,86 %
AUP	S&P 500		28,71 %	22,01 %	18,40 %	20,48 %	31,49 %	30,89 %
DU	S&P 500		28,71 %	21,40 %	18,40 %	19,88 %	31,49 %	30,18 %
IU	S&P 500		28,71 %	22,99 %	18,40 %	21,45 %	31,49 %	31,91 %
XS	S&P 500		28,71 %	26,59 %	18,40 %	20,54 %	31,49 %	31,47 %
XSH	S&P 500		28,71 %	23,81 %	18,40 %	21,24 %	31,49 %	31,86 %
ZEH	S&P 500		28,71 %	21,65 %	18,40 %	19,39 %	31,49 %	27,89 %
ZFH	S&P 500		28,71 %	21,29 %	18,40 %	19,27 %	31,49 %	27,60 %
ZGH	S&P 500		28,71 %	22,11 %	18,40 %	18,83 %	31,49 %	29,21 %
ZU	S&P 500		28,71 %	22,93 %	18,40 %	21,39 %	31,49 %	31,81 %
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>								
AE	S&P 500		28,71 %	43,84 %	18,40 %	-0,94 %	31,49 %	25,94 %
AEH	S&P 500		28,71 %	32,34 %	18,40 %	6,15 %	31,49 %	19,94 %
AU	S&P 500		28,71 %	33,69 %	18,40 %	7,97 %	31,49 %	23,65 %
AUP	S&P 500		28,71 %	33,70 %	18,40 %	7,97 %	31,49 %	23,73 %
DE	S&P 500		28,71 %	43,55 %	18,40 %	-1,14 %	31,49 %	25,72 %
DEH	S&P 500		28,71 %	32,08 %	18,40 %	5,98 %	31,49 %	19,65 %
DU	S&P 500		28,71 %	33,42 %	18,40 %	7,76 %	31,49 %	23,47 %
IE	S&P 500		28,71 %	44,35 %	18,40 %	-0,64 %	31,49 %	26,29 %
IEC	S&P 500		28,71 %	32,81 %	18,40 %	6,54 %	31,49 %	20,37 %
IEH	S&P 500		28,71 %	32,84 %	18,40 %	6,50 %	31,49 %	20,31 %
IFH	S&P 500		28,71 %	32,50 %	18,40 %	6,38 %	31,49 %	20,06 %
IG	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. Mai 2019	28,71 %	35,45 %	18,40 %	5,05 %	11,67 %	7,30 %
IU	S&P 500		28,71 %	34,19 %	18,40 %	8,35 %	31,49 %	24,07 %
NE	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	28,71 %	44,70 %	12,39 %	7,24 %	k. A.	k. A.
NG	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	28,71 %	35,62 %	12,39 %	5,28 %	k. A.	k. A.
NU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. September 2020	28,71 %	34,41 %	12,39 %	11,13 %	k. A.	k. A.

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
XG	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 20. Mai 2020	28,71 %	35,73 %	29,86 %	5,63 %	k. A.	k. A.
ZEH	S&P 500		28,71 %	32,69 %	18,40 %	6,44 %	31,49 %	20,21 %
ZFH	S&P 500		28,71 %	32,38 %	18,40 %	6,24 %	31,49 %	19,88 %
ZU	S&P 500		28,71 %	34,02 %	18,40 %	8,24 %	31,49 %	23,98 %
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities</b>								
AE	MSCI Europe		25,85 %	28,58 %	-2,82 %	6,41 %	26,88 %	31,29 %
ASH	MSCI Europe		25,85 %	29,32 %	-2,82 %	6,82 %	26,88 %	33,85 %
AUH	MSCI Europe		25,85 %	29,60 %	-2,82 %	7,77 %	26,88 %	35,07 %
DE	MSCI Europe		25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,08 %	26,88 %	30,85 %
IE	MSCI Europe		25,85 %	29,55 %	-2,82 %	7,29 %	26,88 %	32,39 %
W	MSCI Europe		25,85 %	28,32 %	-2,82 %	6,40 %	26,88 %	31,36 %
XE	MSCI Europe		25,85 %	30,39 %	-2,82 %	8,12 %	26,88 %	33,46 %
ZE	MSCI Europe	Wertentwicklung seit Auflegung am 15. Juli 2021	6,81 %	9,50 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZUH	MSCI Europe		25,85 %	30,33 %	-2,82 %	8,53 %	26,88 %	36,01 %
1E	MSCI Europe		25,85 %	28,61 %	-2,82 %	6,47 %	26,88 %	31,39 %
1EP	MSCI Europe		25,85 %	28,57 %	-2,82 %	6,41 %	26,88 %	31,26 %
1G	MSCI Europe		25,85 %	20,63 %	-2,82 %	12,48 %	26,88 %	24,03 %
1GP	MSCI Europe		25,85 %	20,59 %	-2,82 %	12,43 %	26,88 %	23,95 %
2E	MSCI Europe		25,85 %	29,19 %	-2,82 %	7,11 %	26,88 %	32,24 %
2G	MSCI Europe		25,85 %	21,18 %	-2,82 %	13,15 %	26,88 %	24,82 %
2U	MSCI Europe		25,85 %	20,14 %	-2,82 %	16,81 %	26,88 %	29,92 %
3E	MSCI Europe		25,85 %	29,36 %	-2,82 %	7,26 %	26,88 %	32,47 %
3G	MSCI Europe		25,85 %	21,35 %	-2,82 %	13,31 %	26,88 %	25,05 %
3GP	MSCI Europe		25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,26 %	26,88 %	24,98 %
4E	MSCI Europe		25,85 %	30,48 %	-2,82 %	8,19 %	26,88 %	33,53 %
4G	MSCI Europe		25,85 %	22,45 %	-2,82 %	14,32 %	26,88 %	26,13 %
8E	MSCI Europe		25,85 %	29,13 %	-2,82 %	7,07 %	26,88 %	32,11 %
8G	MSCI Europe		25,85 %	21,13 %	-2,82 %	13,11 %	26,88 %	24,76 %
8U	MSCI Europe		25,85 %	20,13 %	-2,82 %	16,78 %	26,88 %	29,89 %
9E	MSCI Europe		25,85 %	29,42 %	-2,82 %	7,45 %	26,88 %	32,57 %
9G	MSCI Europe		25,85 %	21,38 %	-2,82 %	13,41 %	26,88 %	25,21 %
9GP	MSCI Europe		25,85 %	21,39 %	-2,82 %	13,41 %	26,88 %	25,21 %
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>								
AE	MSCI Europe		25,85 %	20,28 %	-2,82 %	0,02 %	26,88 %	24,76 %
AEP	MSCI Europe		25,85 %	20,27 %	-2,82 %	0,05 %	26,88 %	24,75 %
AUP	MSCI Europe		25,85 %	11,75 %	-2,82 %	8,99 %	26,88 %	22,51 %
DE	MSCI Europe		25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,35 %	26,88 %	24,33 %
DEP	MSCI Europe		25,85 %	19,85 %	-2,82 %	-0,32 %	26,88 %	24,36 %
IE	MSCI Europe		25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,86 %	26,88 %	25,72 %
IEP	MSCI Europe		25,85 %	21,42 %	-2,82 %	0,89 %	26,88 %	25,72 %
ZE	MSCI Europe		25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,80 %	26,88 %	25,79 %
ZEP	MSCI Europe		25,85 %	21,18 %	-2,82 %	0,76 %	26,88 %	25,79 %
1E	MSCI Europe		25,85 %	20,39 %	-2,82 %	0,15 %	26,88 %	25,22 %
1EP	MSCI Europe		25,85 %	20,38 %	-2,82 %	0,15 %	26,88 %	24,77 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1G	MSCI Europe		25,85 %	12,93 %	-2,82 %	5,79 %	26,88 %	18,14 %
1GP	MSCI Europe		25,85 %	12,92 %	-2,82 %	5,78 %	26,88 %	17,46 %
2E	MSCI Europe		25,85 %	21,13 %	-2,82 %	0,76 %	26,88 %	25,72 %
2EP	MSCI Europe		25,85 %	21,24 %	-2,82 %	0,78 %	26,88 %	25,73 %
2G	MSCI Europe		25,85 %	13,71 %	-2,82 %	6,50 %	26,88 %	18,76 %
2GP	MSCI Europe		25,85 %	13,72 %	-2,82 %	6,48 %	26,88 %	18,76 %
3EP	MSCI Europe		25,85 %	21,30 %	-2,82 %	0,90 %	26,88 %	25,82 %
3G	MSCI Europe		25,85 %	13,77 %	-2,82 %	6,59 %	26,88 %	19,07 %
3GP	MSCI Europe		25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,58 %	26,88 %	19,11 %
4GP	MSCI Europe		25,85 %	14,76 %	-2,82 %	7,50 %	26,88 %	20,56 %
8E	MSCI Europe		25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,72 %	26,88 %	25,58 %
8EP	MSCI Europe		25,85 %	21,08 %	-2,82 %	0,71 %	26,88 %	25,60 %
8G	MSCI Europe		25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,40 %	26,88 %	18,33 %
8GP	MSCI Europe		25,85 %	13,57 %	-2,82 %	6,38 %	26,88 %	18,82 %
9EP	MSCI Europe		25,85 %	21,37 %	-2,82 %	1,04 %	26,88 %	26,06 %
9G	MSCI Europe		25,85 %	13,83 %	-2,82 %	6,65 %	26,88 %	18,80 %
9GP	MSCI Europe		25,85 %	13,78 %	-2,82 %	6,69 %	26,88 %	18,85 %
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities</b>								
AE	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	22,58 %	7,78 %	13,08 %	29,30 %	37,00 %
ASH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	23,34 %	7,78 %	13,61 %	29,30 %	39,80 %
AUH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	23,69 %	7,78 %	14,73 %	29,30 %	40,82 %
DE	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	21,48 %	7,78 %	12,07 %	29,30 %	35,76 %
DUH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	22,60 %	7,78 %	13,74 %	29,30 %	39,55 %
IE	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %	29,30 %	38,01 %
W	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	22,52 %	7,78 %	13,03 %	29,30 %	36,92 %
ZE	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	23,50 %	7,78 %	13,93 %	29,30 %	38,01 %
ZFH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	23,07 %	7,78 %	13,72 %	29,30 %	37,40 %
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>								
IE	EMIX Smaller European Companies	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	23,41 %	20,83 %	7,78 %	9,80 %	13,26 %	13,84 %
ZE	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,65 %	7,78 %	9,63 %	29,30 %	37,23 %
1E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %	29,30 %	36,47 %
1EP	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	19,91 %	7,78 %	8,96 %	29,30 %	36,46 %
1FH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	19,48 %	7,78 %	8,77 %	29,30 %	36,04 %
1G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	12,47 %	7,78 %	15,10 %	29,30 %	28,81 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1UH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,95 %	7,78 %	10,56 %	29,30 %	40,45 %
2E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,69 %	7,78 %	9,67 %	29,30 %	37,30 %
2G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,25 %	7,78 %	15,91 %	29,30 %	29,63 %
3E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %	29,30 %	37,61 %
3EP	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,88 %	7,78 %	9,84 %	29,30 %	37,56 %
3FH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,44 %	7,78 %	9,65 %	29,30 %	37,19 %
3G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,03 %	29,30 %	29,86 %
3GP	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,39 %	7,78 %	16,02 %	29,30 %	29,85 %
3UH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	21,93 %	7,78 %	11,45 %	29,30 %	41,40 %
4E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	21,90 %	7,78 %	10,77 %	29,30 %	38,65 %
4G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	14,34 %	7,78 %	17,01 %	29,30 %	30,91 %
8E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,64 %	7,78 %	9,62 %	29,30 %	37,25 %
8G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,16 %	7,78 %	15,80 %	29,30 %	29,54 %
9E	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,93 %	7,78 %	9,89 %	29,30 %	37,70 %
9EP	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,99 %	7,78 %	9,99 %	29,30 %	37,79 %
9FH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	20,47 %	7,78 %	9,72 %	29,30 %	37,27 %
9G	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,43 %	7,78 %	16,08 %	29,30 %	29,98 %
9GP	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	13,48 %	7,78 %	16,16 %	29,30 %	29,98 %
9UH	EMIX Smaller European Companies		23,41 %	21,99 %	7,78 %	11,48 %	29,30 %	41,58 %
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
AE	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	25,17 %	2,83 %	8,47 %	27,59 %	32,63 %
AGH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	25,60 %	2,83 %	8,30 %	27,59 %	33,91 %
AUH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,16 %	2,83 %	9,89 %	27,59 %	36,39 %
DUH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	25,49 %	2,83 %	9,28 %	27,59 %	35,65 %
IE	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,23 %	2,83 %	9,40 %	27,59 %	33,76 %
ZE	FTSE World Europe ex UK	Wertentwicklung seit Auflegung am 14. Oktober 2021	6,24 %	5,96 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZG	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	18,29 %	2,83 %	15,45 %	27,59 %	26,21 %
ZGH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,53 %	2,83 %	9,08 %	27,59 %	34,89 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - European Select</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1E	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %	27,59 %	32,85 %
1EP	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	25,35 %	2,83 %	8,63 %	27,59 %	32,84 %
1SH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,20 %	27,59 %	35,47 %
1U	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	16,51 %	2,83 %	18,41 %	27,59 %	30,47 %
1UH	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,35 %	2,83 %	10,09 %	27,59 %	36,62 %
2E	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,09 %	2,83 %	9,28 %	27,59 %	33,65 %
2EP	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,12 %	2,83 %	9,35 %	27,59 %	33,70 %
3E	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,32 %	2,83 %	9,47 %	27,59 %	33,80 %
3U	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	17,41 %	2,83 %	19,33 %	27,59 %	31,38 %
8E	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %	27,59 %	33,59 %
8EP	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,04 %	2,83 %	9,23 %	27,59 %	33,58 %
9E	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	26,37 %	2,83 %	9,52 %	27,59 %	33,86 %
9U	FTSE World Europe ex UK		25,16 %	17,50 %	2,83 %	19,47 %	27,59 %	31,49 %
<b>Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies</b>								
IE	EMIX Smaller European Companies ex UK	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Juni 2019	23,02 %	22,87 %	12,55 %	14,97 %	11,00 %	9,26 %
ZE	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,69 %	12,55 %	14,80 %	27,77 %	31,09 %
1E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %	27,77 %	30,28 %
1EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	21,93 %	12,55 %	14,09 %	27,77 %	30,28 %
1FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	21,45 %	12,55 %	13,84 %	27,77 %	29,85 %
2E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,73 %	12,55 %	14,83 %	27,77 %	31,03 %
3E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %	27,77 %	31,21 %
3EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,90 %	12,55 %	14,99 %	27,77 %	31,23 %
3FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,41 %	12,55 %	14,74 %	27,77 %	30,83 %
8E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,68 %	12,55 %	14,78 %	27,77 %	31,13 %
9E	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %	27,77 %	31,28 %
9EP	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,95 %	12,55 %	15,04 %	27,77 %	31,35 %
9FH	EMIX Smaller European Companies ex UK		23,02 %	22,45 %	12,55 %	14,77 %	27,77 %	30,77 %
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>								
AEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	0,42 %	22,75 %	21,55 %	19,48 %	22,20 %
AU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %	19,48 %	26,13 %
AUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	1,49 %	22,75 %	23,68 %	19,48 %	26,13 %
DEH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	-0,34 %	22,75 %	20,64 %	19,48 %	21,28 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.



## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
DU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %	19,48 %	25,21 %
DUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	0,74 %	22,75 %	22,76 %	19,48 %	25,15 %
IEP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	10,12 %	22,75 %	14,36 %	19,48 %	29,48 %
IU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. November 2019	-2,65 %	2,29 %	22,75 %	24,68 %	5,07 %	6,59 %
W	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	1,29 %	22,75 %	23,43 %	19,48 %	25,89 %
XU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 17. Mai 2019	-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %	10,94 %	16,94 %
XUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	3,18 %	22,75 %	25,74 %	19,48 %	28,27 %
ZG	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,82 %	19,48 %	22,09 %
ZGH	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	1,50 %	22,75 %	21,94 %	19,48 %	24,37 %
ZGP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	3,16 %	22,75 %	20,76 %	19,48 %	22,11 %
ZU	MSCI AC Asia Pacific ex Japan	Wertentwicklung seit Auflegung am 11. November 2021	-2,63 %	1,62 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZUP	MSCI AC Asia Pacific ex Japan		-2,65 %	2,26 %	22,75 %	24,61 %	19,48 %	27,12 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
AEH	MSCI World - Information Technology		30,15 %	36,06 %	44,26 %	40,63 %	48,15 %	48,44 %
AS	MSCI World - Information Technology		30,15 %	40,24 %	44,26 %	40,53 %	48,15 %	51,03 %
AU	MSCI World - Information Technology		30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %	48,15 %	53,08 %
AUP	MSCI World - Information Technology		30,15 %	37,48 %	44,26 %	42,98 %	48,15 %	53,09 %
BU	MSCI World - Information Technology		30,15 %	36,93 %	44,26 %	42,41 %	48,15 %	52,46 %
DEH	MSCI World - Information Technology		30,15 %	35,58 %	44,26 %	40,18 %	48,15 %	48,06 %
DU	MSCI World - Information Technology		30,15 %	37,00 %	44,26 %	42,48 %	48,15 %	52,54 %
IE	MSCI World - Information Technology	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	30,15 %	49,26 %	40,01 %	27,46 %	k. A.	k. A.
IEH	MSCI World - Information Technology		30,15 %	37,27 %	44,26 %	41,91 %	48,15 %	49,71 %
IG	MSCI World - Information Technology		30,15 %	40,01 %	44,26 %	39,81 %	48,15 %	48,40 %
IU	MSCI World - Information Technology	Wertentwicklung seit Auflegung am 10. Januar 2020	30,15 %	38,72 %	40,01 %	40,48 %	k. A.	k. A.
ZEH	MSCI World - Information Technology		30,15 %	37,14 %	44,26 %	41,73 %	48,15 %	49,68 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Technology</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZFH	MSCI World - Information Technology		30,15 %	36,74 %	44,26 %	41,68 %	48,15 %	49,21 %
ZG	MSCI World - Information Technology		30,15 %	39,88 %	44,26 %	39,67 %	48,15 %	48,45 %
ZU	MSCI World - Information Technology		30,15 %	38,58 %	44,26 %	44,12 %	48,15 %	54,29 %
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
AE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit der Auflegung am 12. Februar 2020	18,32 %	16,67 %	-9,32 %	-15,31 %	k. A.	k. A.
AEH	FTSE All Share		18,32 %	8,76 %	-9,82 %	-11,08 %	19,17 %	20,61 %
AFH	FTSE All Share		18,32 %	8,55 %	-9,82 %	-11,06 %	19,17 %	20,15 %
AG	FTSE All Share		18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %	19,17 %	22,05 %
AGP	FTSE All Share		18,32 %	9,44 %	-9,82 %	-11,26 %	19,17 %	22,06 %
DEH	FTSE All Share		18,32 %	7,90 %	-9,82 %	-11,77 %	19,17 %	19,58 %
DG	FTSE All Share		18,32 %	8,56 %	-9,82 %	-11,97 %	19,17 %	21,01 %
IE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. November 2019	18,32 %	17,84 %	-9,82 %	-15,11 %	3,00 %	5,47 %
IEH	FTSE All Share		18,32 %	9,79 %	-9,82 %	-10,24 %	19,17 %	21,79 %
IG	FTSE All Share		18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %	19,17 %	23,21 %
IGP	FTSE All Share		18,32 %	10,48 %	-9,82 %	-10,41 %	19,17 %	23,24 %
NEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	10,02 %	14,13 %	18,52 %	k. A.	k. A.
NFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	9,83 %	14,13 %	18,55 %	k. A.	k. A.
NG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %	k. A.	k. A.
NGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	10,75 %	14,13 %	18,66 %	k. A.	k. A.
NUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	11,11 %	14,13 %	18,86 %	k. A.	k. A.
TEH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	9,99 %	14,13 %	18,52 %	k. A.	k. A.
TFH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	9,77 %	14,13 %	18,55 %	k. A.	k. A.
TG	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %	k. A.	k. A.
TGP	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	10,72 %	14,13 %	18,66 %	k. A.	k. A.
TUH	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Oktober 2020	18,32 %	11,08 %	14,13 %	18,86 %	k. A.	k. A.
ZE	FTSE All Share	Wertentwicklung seit der Auflegung am 12. Februar 2020	18,32 %	17,53 %	-9,32 %	-14,76 %	k. A.	k. A.
ZEH	FTSE All Share		18,32 %	9,58 %	-9,82 %	-10,44 %	19,17 %	21,52 %
ZFH	FTSE All Share		18,32 %	9,39 %	-9,82 %	-10,43 %	19,17 %	21,21 %
ZG	FTSE All Share		18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %	19,17 %	22,97 %
ZGP	FTSE All Share		18,32 %	10,26 %	-9,82 %	-10,59 %	19,17 %	23,02 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZUH	FTSE All Share	War vom 24. September 2020 bis zum 20. November 2020 inaktiv	18,32 %	10,65 %	2,92 %	4,04 %	19,17 %	25,38 %
3EH	FTSE All Share		18,32 %	9,78 %	-9,82 %	-10,25 %	19,17 %	22,35 %
3FH	FTSE All Share	Wertentwicklung bis zur Schließung am 29. November 2019 und seit dem 24. November 2020	18,32 %	9,60 %	2,80 %	4,44 %	15,33 %	16,60 %
3UH	FTSE All Share		18,32 %	10,85 %	-9,82 %	-8,79 %	19,17 %	25,25 %
9EH	FTSE All Share		18,32 %	9,80 %	-9,82 %	-10,27 %	19,17 %	21,75 %
9EP	FTSE All Share		18,32 %	17,80 %	-9,82 %	-15,17 %	19,17 %	30,60 %
9FH	FTSE All Share	Wertentwicklung bis zur Schließung am 29. November 2019	18,32 %	9,64 %	-9,82 %	-10,23 %	19,17 %	21,47 %
9G	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. April 2019	18,32 %	10,50 %	-9,82 %	-10,40 %	4,96 %	7,27 %
9UH	FTSE All Share		18,32 %	10,89 %	-9,82 %	-8,85 %	19,17 %	25,30 %
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
AE	FTSE All Share		18,32 %	25,96 %	-9,82 %	-12,97 %	19,17 %	25,82 %
AEC	FTSE All Share		18,32 %	17,40 %	-9,82 %	-8,16 %	19,17 %	17,16 %
AEH	FTSE All Share		18,32 %	17,39 %	-9,82 %	-8,19 %	19,17 %	17,27 %
AG	FTSE All Share		18,32 %	18,15 %	-9,82 %	-8,07 %	19,17 %	18,75 %
ASC	FTSE All Share		18,32 %	18,24 %	-9,82 %	-7,63 %	19,17 %	19,65 %
AUC	FTSE All Share		18,32 %	18,42 %	-9,82 %	-6,82 %	19,17 %	20,54 %
DE	FTSE All Share		18,32 %	25,02 %	-9,82 %	-13,62 %	19,17 %	24,90 %
DEC	FTSE All Share		18,32 %	16,41 %	-9,82 %	-8,95 %	19,17 %	16,20 %
DEH	FTSE All Share		18,32 %	16,49 %	-9,82 %	-8,86 %	19,17 %	16,37 %
DG	FTSE All Share		18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,76 %	19,17 %	17,87 %
DGP	FTSE All Share		18,32 %	17,15 %	-9,82 %	-8,79 %	19,17 %	17,83 %
IE	FTSE All Share		18,32 %	27,16 %	-9,82 %	-12,14 %	19,17 %	26,91 %
IEH	FTSE All Share		18,32 %	18,49 %	-9,82 %	-7,33 %	19,17 %	18,31 %
IG	FTSE All Share		18,32 %	19,27 %	-9,82 %	-7,19 %	19,17 %	19,84 %
IGP	FTSE All Share		18,32 %	19,28 %	-9,82 %	-7,19 %	19,17 %	19,90 %
IU	FTSE All Share		18,32 %	18,18 %	-9,82 %	-4,23 %	19,17 %	24,64 %
IUH	FTSE All Share		18,32 %	19,70 %	-9,82 %	-5,72 %	19,17 %	21,96 %
LG	FTSE All Share		18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %	19,17 %	20,01 %
LGP	FTSE All Share		18,32 %	19,45 %	-9,82 %	-7,05 %	19,17 %	19,99 %
ZE	FTSE All Share		18,32 %	26,90 %	-9,82 %	-12,32 %	19,17 %	26,69 %
ZEH	FTSE All Share		18,32 %	18,22 %	-9,82 %	-7,49 %	19,17 %	18,09 %
ZFH	FTSE All Share		18,32 %	17,97 %	-9,82 %	-7,62 %	19,17 %	17,71 %
ZG	FTSE All Share		18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %	19,17 %	19,68 %
ZGP	FTSE All Share		18,32 %	19,04 %	-9,82 %	-7,38 %	19,17 %	19,61 %
ZUH	FTSE All Share		18,32 %	19,33 %	-9,82 %	-6,85 %	19,17 %	21,67 %
1EH	FTSE All Share		18,32 %	17,55 %	-9,82 %	-8,07 %	19,17 %	17,41 %
1FH	FTSE All Share		18,32 %	17,27 %	-9,82 %	-8,17 %	19,17 %	17,00 %
1UH	FTSE All Share		18,32 %	18,62 %	-9,82 %	-6,65 %	19,17 %	20,78 %
3EH	FTSE All Share		18,32 %	18,43 %	-9,82 %	-7,32 %	19,17 %	18,25 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - UK Equity Income</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
3FH	FTSE All Share		18,32 %	18,17 %	-9,82 %	-7,46 %	19,17 %	17,93 %
3UH	FTSE All Share		18,32 %	19,53 %	-9,82 %	-5,91 %	19,17 %	21,79 %
9EH	FTSE All Share		18,32 %	18,50 %	-9,82 %	-7,29 %	19,17 %	18,24 %
9FH	FTSE All Share		18,32 %	18,14 %	-9,82 %	-7,44 %	19,17 %	17,88 %
9G	FTSE All Share	Wertentwicklung seit Auflegung am 25. April 2019	18,32 %	19,29 %	-9,82 %	-7,18 %	4,96 %	7,41 %
9UH	FTSE All Share		18,32 %	19,57 %	-9,82 %	-5,90 %	19,17 %	21,76 %
<b>Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity</b>								
IU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %	17,01 %	14,72 %
ZU	MSCI EFM Africa ex-ZA 10/40		11,30 %	0,43 %	0,95 %	-7,63 %	17,01 %	14,74 %
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
AEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	1,63 %	0,66 %	-1,27 %	2,39 %	-0,01 %
AFH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	1,36 %	0,66 %	-1,50 %	2,39 %	-0,35 %
AGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,32 %	0,66 %	-0,78 %	2,39 %	1,21 %
AU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,61 %	0,66 %	0,00 %	2,39 %	3,09 %
DEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	1,13 %	0,66 %	-1,74 %	2,39 %	-0,51 %
DU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,10 %	0,66 %	-0,51 %	2,39 %	2,57 %
IEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,51 %	0,66 %	-0,41 %	2,39 %	0,85 %
IGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,92 %	0,66 %	0,01 %	2,39 %	2,04 %
IU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	3,23 %	0,66 %	0,85 %	2,39 %	3,66 %
XGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	4,04 %	0,66 %	0,79 %	2,39 %	2,92 %
ZE	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	11,23 %	0,66 %	-7,50 %	2,39 %	5,11 %
ZEH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	2,40 %	0,66 %	-0,47 %	2,39 %	0,75 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
ZGH	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	3,14 %	0,66 %	-0,07 %	2,39 %	1,92 %
ZU	90-tägige Average Secured Overnight Financing Rate (SOFR)		0,13 %	3,03 %	0,66 %	0,76 %	2,39 %	3,86 %
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
AE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2021	-0,24 %	-1,02 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
IE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 5. August 2021	-0,24 %	-0,82 %	k. A.	k. A.	k. A.	k. A.
ZE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,48 %	-0,62 %	0,72 %	-0,52 %	3,18 %
1E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %	-0,52 %	2,70 %
1EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,88 %	-0,62 %	0,35 %	-0,52 %	2,71 %
1GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,36 %	-0,62 %	0,84 %	-0,52 %	3,87 %
1UH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,17 %	-0,62 %	1,55 %	-0,52 %	5,65 %
2E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,27 %	-0,62 %	0,96 %	-0,52 %	3,34 %
2EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,18 %	-0,62 %	1,05 %	-0,52 %	3,44 %
2GC	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,28 %	-0,62 %	1,55 %	-0,52 %	4,39 %
2GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,26 %	-0,62 %	1,47 %	-0,52 %	4,61 %
4GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,75 %	-0,62 %	1,99 %	-0,52 %	5,11 %
8E	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %	-0,52 %	3,35 %
8EP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	0,92 %	-0,52 %	3,36 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
8GC	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,25 %	-0,62 %	1,44 %	-0,52 %	4,46 %
8GH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	1,45 %	-0,52 %	4,46 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>								
AE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-1,41 %	-0,62 %	1,24 %	-0,52 %	2,66 %
AFH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-1,58 %	-0,62 %	0,93 %	-0,52 %	2,16 %
AKH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	-0,65 %	-1,14 %	-0,62 %	1,45 %	-0,29 %	0,47 %
ANH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. Juni 2019	-0,65 %	-0,78 %	-0,62 %	1,75 %	-0,29 %	1,37 %
AUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,69 %	-0,62 %	2,47 %	-0,52 %	5,61 %
DE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-1,88 %	-0,62 %	0,67 %	-0,52 %	1,97 %
IE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,70 %	-0,62 %	1,89 %	-0,52 %	3,24 %
IEP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,76 %	-0,62 %	1,68 %	-0,52 %	3,17 %
IGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,11 %	-0,62 %	2,38 %	-0,52 %	4,52 %
INH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 18. Oktober 2019	-0,65 %	-0,09 %	-0,62 %	2,28 %	-0,12 %	1,03 %
IU	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 22. Mai 2019	-0,65 %	-7,81 %	-0,62 %	11,08 %	-0,34 %	1,45 %
IUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,05 %	-0,62 %	3,16 %	-0,52 %	6,20 %
JE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,73 %	-0,62 %	1,69 %	-0,52 %	3,29 %
JGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,01 %	-0,62 %	2,33 %	-0,52 %	4,37 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
JUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,01 %	-0,62 %	2,97 %	-0,52 %	5,72 %
LE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,57 %	-0,62 %	2,04 %	-0,52 %	3,41 %
LEP	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,56 %	-0,62 %	2,04 %	-0,52 %	3,50 %
LGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	0,12 %	-0,62 %	2,48 %	-0,52 %	4,60 %
XE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-0,65 %	-0,30 %	-0,46 %	7,21 %	k. A.	k. A.
XGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 27. November 2019	-0,65 %	0,22 %	-0,62 %	2,79 %	-0,06 %	0,59 %
XUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat	Wertentwicklung seit Auflegung am 8. April 2020	-0,65 %	0,51 %	-0,46 %	7,83 %	k. A.	k. A.
YE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,87 %	-0,62 %	1,63 %	-0,52 %	3,22 %
YGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,17 %	-0,52 %	4,18 %
YUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,21 %	-0,62 %	2,82 %	-0,52 %	5,60 %
ZE	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,94 %	-0,62 %	1,69 %	-0,52 %	3,19 %
ZFH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-1,13 %	-0,62 %	1,39 %	-0,52 %	2,64 %
ZGH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,31 %	-0,62 %	2,23 %	-0,52 %	4,31 %
ZUH	Kumulierter €STR-Durchschnittssatz mit einer Laufzeit von 1 Monat		-0,65 %	-0,24 %	-0,62 %	2,94 %	-0,52 %	6,15 %
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
AE	EURIBOR 3M		-0,55 %	7,41 %	-0,43 %	-0,45 %	-0,36 %	20,39 %
AEP	EURIBOR 3M		-0,55 %	6,49 %	-0,43 %	0,16 %	-0,36 %	23,71 %
AUH	EURIBOR 3M		-0,55 %	7,97 %	-0,43 %	1,39 %	-0,36 %	21,26 %
DE	EURIBOR 3M		-0,55 %	6,00 %	-0,43 %	-0,40 %	-0,36 %	19,81 %
IE	EURIBOR 3M		-0,55 %	6,83 %	-0,43 %	0,93 %	-0,36 %	21,60 %
IGH	EURIBOR 3M		-0,55 %	7,42 %	-0,43 %	1,29 %	-0,36 %	21,06 %
LE	EURIBOR 3M		-0,55 %	7,00 %	-0,43 %	1,58 %	-0,36 %	21,34 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Wertentwicklung der Anteilsklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
XGH	EURIBOR 3M		-0,55 %	9,16 %	-0,43 %	2,22 %	-0,36 %	27,22 %
ZE	EURIBOR 3M		-0,55 %	7,37 %	-0,43 %	0,83 %	-0,36 %	21,75 %
ZF	EURIBOR 3M		-0,55 %	3,39 %	-0,43 %	0,62 %	-0,36 %	16,69 %
ZFH	EURIBOR 3M		-0,55 %	6,53 %	-0,43 %	0,43 %	-0,36 %	19,37 %
ZGH	EURIBOR 3M		-0,55 %	8,94 %	-0,43 %	1,31 %	-0,36 %	21,13 %
<b>Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha</b>								
AEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	23,64 %	18,40 %	21,51 %	23,57 %	17,88 %
AU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	24,80 %	18,40 %	23,40 %	23,57 %	21,24 %
DEH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	22,95 %	18,40 %	20,92 %	23,57 %	17,33 %
DU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	24,18 %	18,40 %	22,78 %	23,57 %	20,61 %
IU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	25,93 %	18,40 %	24,50 %	23,57 %	22,29 %
ZU	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	25,84 %	18,40 %	24,34 %	23,57 %	22,08 %
1E	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	34,43 %	18,40 %	13,32 %	23,57 %	23,20 %
1EH	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	23,74 %	18,40 %	21,57 %	23,57 %	18,04 %
1U	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	24,94 %	18,40 %	23,52 %	23,57 %	21,42 %
2E	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	35,61 %	18,40 %	14,30 %	23,57 %	24,23 %
2U	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	26,14 %	18,40 %	24,65 %	23,57 %	22,40 %
3U	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	25,88 %	18,40 %	24,45 %	23,57 %	22,08 %
8E	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	35,53 %	18,40 %	14,25 %	23,57 %	23,79 %
8U	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	28,71 %	25,97 %	18,40 %	24,53 %	23,57 %	21,93 %
9U	S&P 500	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	28,71 %	26,03 %	18,40 %	24,48 %	23,57 %	22,39 %
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>								
AEH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	7,85 %	16,82 %	21,19 %	19,61 %	22,96 %
AU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	9,02 %	16,82 %	23,11 %	19,61 %	25,94 %
DEH	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	7,35 %	16,82 %	20,47 %	19,61 %	23,45 %
DU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	8,48 %	16,82 %	22,56 %	19,61 %	25,97 %
IU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	10,00 %	16,82 %	24,22 %	19,61 %	28,28 %
ZU	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	9,92 %	16,82 %	24,08 %	19,61 %	27,20 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilsklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.



## Wertentwicklung der Anteilklassen (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Anteilklasse	Name der Benchmark	Kommentare	31. Dezember 2021		31. Dezember 2020		31. Dezember 2019	
			Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite	Benchmark	Portfolio-Rendite
<b>Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha</b>								
<i>(Fortsetzung)</i>								
1E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	17,43 %	16,82 %	13,07 %	19,61 %	29,80 %
1U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	9,14 %	16,82 %	23,25 %	19,61 %	27,83 %
2E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	18,52 %	16,82 %	14,04 %	19,61 %	29,09 %
2U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 26. Januar 2019	19,04 %	10,08 %	16,82 %	24,31 %	19,61 %	27,26 %
8E	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	18,39 %	16,82 %	13,99 %	19,61 %	30,28 %
8U	MSCI AC World	Wertentwicklung seit Auflegung am 28. Januar 2019	19,04 %	10,04 %	16,82 %	24,26 %	19,61 %	30,04 %
<b>Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities</b>								
AEH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	22,67 %	-3,12 %	-3,93 %	7,69 %	3,20 %
AFH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	22,48 %	-3,12 %	-4,10 %	7,69 %	2,88 %
AGH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,16 %	-3,12 %	-3,80 %	7,69 %	4,45 %
ASH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,70 %	-3,12 %	-3,11 %	7,69 %	5,46 %
AU	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	24,03 %	-3,12 %	-2,37 %	7,69 %	6,49 %
DEH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	22,07 %	-3,12 %	-4,41 %	7,69 %	2,71 %
DU	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,44 %	-3,12 %	-2,85 %	7,69 %	6,04 %
IEH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,89 %	-3,12 %	-2,91 %	7,69 %	4,31 %
IG	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	26,34 %	-3,12 %	-4,55 %	7,69 %	3,34 %
IGH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	24,40 %	-3,12 %	-2,79 %	7,69 %	5,48 %
IU	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	25,26 %	-3,12 %	-1,34 %	7,69 %	7,66 %
NG	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	26,86 %	-3,12 %	-4,05 %	7,69 %	3,80 %
XU	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	26,32 %	-3,12 %	-0,49 %	7,69 %	8,54 %
ZEH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,83 %	-3,12 %	-2,96 %	7,69 %	4,12 %
ZFH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	23,58 %	-3,12 %	-3,15 %	7,69 %	3,80 %
ZGH	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	24,31 %	-3,12 %	-2,85 %	7,69 %	5,47 %
ZU	Bloomberg Commodity Index		27,11 %	25,19 %	-3,12 %	-1,38 %	7,69 %	7,65 %

Hinweis: Die historische Gesamtentwicklung ist keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Nettoinventarwerte von Anteilklassen können steigen oder sinken. Die Wertentwicklung berücksichtigt alle maßgeblichen Gebühren und Ausschüttungen während des Kalenderjahrs zum 31. Dezember 2021 (sie berücksichtigt jedoch keinen Ausgabeaufschlag, wie in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses dargelegt). Die Entwicklung weicht von Anteilklasse zu Anteilklasse ab und ist von den geltenden Anlageverwaltungs- und Anlegerservicegebühren abhängig, die in Erläuterung 5 des Jahresabschlusses genannt sind. Darüber hinaus können in Abhängigkeit von der Währung, in der die Anteilklasse ausgewiesen ist, und der Basiswährung des Portfolios auch Währungsschwankungen einen Einfluss auf die Entwicklung haben. Die Renditen werden in der Währung angegeben, in der die Portfolios ausgewiesen sind.

## Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transaction Regulation, „SFTR“) führt Meldepflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Total Return Swaps ein. Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ist gemäß der Definition in Artikel 3(11) der SFTR Folgendes:

- ein Pensionsgeschäft/umgekehrtes Pensionsgeschäft;
- ein Wertpapier- oder Warenverleihgeschäft und ein Wertpapier- oder Warenentleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft; oder
- ein Lombardgeschäft.

Zum 31. März 2022 hielt die SICAV Total Return Swaps („TRS“) als eine Art von Instrumenten, die in den Geltungsbereich der SFTR fallen.

### Weltweite Daten

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert	% des Nettovermögens
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	140.624	0,57
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	990.355	0,80
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	530.036	0,42
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	2.725.280	2,75
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	17.857.131	3,26

### Daten zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Berichtsjahr zum 31. März 2022 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

### Konzentrationsdaten

Bei allen zum 31. März 2022 für TRS erhaltenen Sicherheiten handelt es sich um Barsicherheiten. Die Angabe der zehn größten Emittenten ist daher nicht möglich.

Die folgende Tabelle bietet Details zu den zehn wichtigsten Kontrahenten (auf Basis des Bruttovolumens ausstehender Transaktionen) in Bezug auf TRS, die zum 31. März 2022 vom Portfolio gehalten wurden:

Name des Portfolios	Art des Vermögenswerts	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn und Verlust in der Portfolio-Basiswährung und als absoluter Wert
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	TRS	UBS	107.980
		Bank of America Merrill Lynch	32.644
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	TRS	UBS	837.280
		Goldman Sachs	153.075
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	TRS	UBS	318.592
		Bank of America Merrill Lynch	211.444
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	TRS	UBS	2.725.280
		Goldman Sachs	5.805.622
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	TRS	Macquarie	5.184.353
		JPMorgan	3.701.658
		Citigroup Global Markets	1.627.423
		Credit Suisse	1.538.075

### Verwahrung erhaltener Sicherheiten

Barsicherheiten werden im Geldkonto des jeweiligen Portfolios bei der Citibank Europe plc, Niederlassung Luxemburg, gehalten.

Die folgende Tabelle zeigt die von der SICAV zum 31. März 2022 gehaltenen Termineinlagen:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	UBS	EUR	20.000
		<b>Gesamt</b>	<b>EUR</b>	<b>20.000</b>
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	99.000
		<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>99.000</b>
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	1.920.000
		<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>1.920.000</b>

## Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Goldman Sachs	USD	8.050.000
		Macquarie	USD	7.050.000
		JPMorgan	USD	8.500.000*
		Citigroup Global Markets	USD	2.191.000
		Credit Suisse	USD	2.070.000
		<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>27.861.000</b>

\*Diese Sicherheiten beziehen sich möglicherweise auf andere Transaktionen als TRS, die nicht unter die Offenlegung gemäß SFT-Verordnung fallen.

### Transaktionsdaten insgesamt

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Laufzeit (Sicherheit)	Währung der Sicherheit	Laufzeit (SFT/TRS)	Land der Niederlassung (Kontrahent)	Abwicklung und Clearing	Qualität der Sicherheit
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	EUR	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha	Barmittel	Restlaufzeit	USD	3 Monate bis 1 Jahr / mehr als 1 Jahr	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities	Barmittel	Restlaufzeit	USD	weniger als 1 Tag / 1 Tag bis 1 Monat	UK	Bilateral	k. A. - Barmittel

### Verwahrung gewährter Sicherheiten

An die Kontrahenten gezahlte Barmittel und Sicherheiten werden auf separate Konten beim Kontrahenten eingezahlt.

Der Betrag der für TRS gewährten Sicherheiten zum 31. März 2022 ist wie folgt:

Name des Portfolios	Art der Sicherheit	Kontrahent	Währung der Sicherheit	Betrag der Sicherheit	% der zum Ende des Geschäftsjahres gehaltenen Sicherheiten nach Kategorie
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha	Barmittel	Bank of America Merrill Lynch	USD	140.000	0,57
		UBS	USD	310.000	1,25
		<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>450.000</b>	<b>1,82</b>
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha	Barmittel	Goldman Sachs	EUR	90.000	0,07
		<b>Gesamt</b>	<b>EUR</b>	<b>90.000</b>	<b>0,07</b>
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha	Barmittel	UBS	USD	870.000	0,69
		<b>Gesamt</b>	<b>USD</b>	<b>870.000</b>	<b>0,69</b>

### Rendite/Kosten

Die Rendite und die Kosten von TRS-Transaktionen zum 31. März 2022 werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens des jeweiligen Portfolios unter der Überschrift „Zinsaufwand aus Swaps“, „Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps“ und „Änderung des nicht realisierten Nettogewinns/(-verlusts) aus Swaps“ ausgewiesen.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

### Anlageziele und Anlagepolitik

#### Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies

Das American Smaller Companies Portfolio strebt einen Kapitalzuwachs durch überwiegende Investition in Aktien von „American Smaller Companies“ (kleineren amerikanischen Unternehmen) mit Sitz oder bedeutender Geschäftstätigkeit in den USA an.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen.

Das Portfolio wird aktiv unter Bezugnahme auf den Russell 2500 Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann. Abweichungen vom Index, einschließlich der Begrenzung des Risikoniveaus im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

#### Threadneedle (Lux) – Asia Equities

Das Asia Equities Portfolio strebt einen Kapitalzuwachs an, indem es überwiegend in die Aktienwerte von Unternehmen mit Sitz in Asien (ohne Japan) oder mit erheblicher Geschäftstätigkeit in Asien (ohne Japan) investiert, einschließlich über Aktienzertifikate. Das Portfolio kann bis zu 40 % seines Nettoinventarwerts über das China-Hong Kong Stock Connect-Programm in chinesische A-Aktien investieren.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen.

Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

#### Threadneedle (Lux) – European Select

Das European Select Portfolio strebt einen Kapitalzuwachs durch überwiegende Investition in die Aktien von Unternehmen mit Sitz oder überwiegender Geschäftstätigkeit in Kontinentaleuropa an. Hierzu können große, mittlere und kleinere Unternehmen zählen.

Es gibt keine besondere sektorale Spezialisierung. Aufgrund dieser Investmentstrategie hat das Portfolio auch die Flexibilität, erhebliche Aktien- und Sektorpositionen zu halten, was mit einer höheren Volatilität verbunden sein kann. Das Portfolio kann darüber hinaus in andere Wertpapiere investieren (einschließlich festverzinslicher Wertpapiere, sonstiger Aktien und Geldmarktinstrumente).

Das Portfolio wird aktiv in Bezug auf den FTSE World Europe ex UK Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird.

Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

#### Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies

Das European Smaller Companies Portfolio ist bestrebt, Kapitalzuwachs zu erzielen, und zwar in erster Linie durch Anlage in Aktienwerte kleinerer europäischer Unternehmen (mit Ausnahme des Vereinigten Königreichs). Bei diesem Portfolio bezieht sich die Definition „European Smaller Companies“ (kleinere europäische Unternehmen) auf Unternehmen, die zum Kaufzeitpunkt nicht in den Top 225 der Unternehmen im FTSE World Europe ex UK Index vertreten sind.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen.

Das Portfolio wird aktiv in Bezug auf den EMIX Smaller European Companies Ex UK Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – Global Equity Income

Das Global Equity Income Portfolio strebt Erträge mit Aussicht auf einen Kapitalzuwachs an. Das Portfolio wird in erster Linie weltweit in Aktienwerten anlegen. Die Erträge werden in Form von Dividenden ausgeschüttet.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen.

Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den MSCI ACWI Index verwaltet.

Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Angaben zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – Global Focus

Das Global Focus Portfolio strebt Kapitalzuwachs an, und zwar in erster Linie durch Anlage in ein konzentriertes Portfolio aus Aktienwerten von Unternehmen, die in Industrie- oder Schwellenländern notiert oder ansässig sind oder dort einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben. In zweiter Linie kann das Portfolio in Wertpapiere, die in Aktienwerte umgewandelt werden können, und/oder Optionsscheine anlegen.

Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den MSCI ACWI Index verwaltet.

Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Angaben zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – Global Select

Das Global Select Portfolio strebt einen Kapitalzuwachs durch überwiegende Investition in Aktien von Unternehmen weltweit an. Bei der „Select“-Anlagemethode besitzt das Portfolio die Flexibilität, in großem Umfang Aktien- und Sektorpositionen einzugehen, was zu einer erhöhten Volatilität führen kann.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen. Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den MSCI ACWI Index verwaltet.

Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies

Das Global Smaller Companies Portfolio strebt einen Kapitalzuwachs durch überwiegende Investition in die Aktien von globalen kleineren Unternehmen an. Das Portfolio kann darüber hinaus in andere Wertpapiere investieren (einschließlich festverzinslicher Wertpapiere, sonstiger Aktien und Geldmarktinstrumente).

Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den MSCI World Small Cap Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

### Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

Das Pan European Smaller Companies Portfolio ist bestrebt, Kapitalzuwachs zu erzielen, und zwar in erster Linie durch Anlage in Aktienwerte kleinerer europäischer Unternehmen. Der Unterberater wird gewöhnlich Anlagen in Unternehmen am höheren Ende der Marktkapitalisierungsskala der kleineren Unternehmen bevorzugen.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Absicherungszwecken einsetzen. Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den EMIX Smaller European Companies Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Unternehmen, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

Das European High Yield Bond Portfolio strebt eine Gesamtrendite aus Erträgen und Kapitalzuwachs durch die überwiegende Anlage in auf Euro oder Pfund Sterling lautenden festverzinslichen Wertpapieren an, die ein Rating unter Investment-Grade aufweisen.

Das Portfolio investiert in erster Linie in festverzinslichen Wertpapieren von Unternehmen, die ihren Hauptsitz in Europa haben oder in wesentlichem Umfang dort tätig sind. Das Portfolio kann in CoCo-Bonds investieren (nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios).

Wenn Wertpapiere auf eine andere Währung als Euro lauten, wird in der Regel beabsichtigt, dass sie gewöhnlich in Euro abgesichert werden.

Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zum Zwecke der Risiko- oder Kostensenkung einsetzen, d. h. wenn der Einsatz eines derivativen Finanzinstruments wirtschaftlich angemessen ist.

Das gewichtete durchschnittliche Kreditrating des Portfolios wird voraussichtlich zwischen Ba2 und B2 von Moody's (oder vergleichbar) liegen. Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfolioperformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Das Portfolio fördert ökologische und soziale Merkmale, indem es darauf abzielt, im Vergleich zum Index über rollierende 12-Monatszeiträume gut abzuschneiden. Als Maßstab für die Bewertung wird das nachfolgend beschriebene Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen. Der Index ist nicht darauf ausgelegt, speziell ökologische oder soziale Merkmale zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses, des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

### Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities

Das Pan European ESG Equities Portfolio ist bestrebt, Kapitalzuwachs zu erzielen, und zwar durch Anlagen in Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Eigenschaften (ESG = Umwelt, Soziales, Unternehmensführung).

Das Portfolio wird aktiv verwaltet und investiert vornehmlich in Aktienwerte großer Unternehmen, die ihren Sitz in Europa haben oder einen bedeutenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Europa ausüben. Des Weiteren kann das Portfolio in Aktienwerte kleinerer europäischer Unternehmen und in Geldmarktinstrumente investieren. Das Portfolio kann derivative Finanzinstrumente zu Anlage- und zu Absicherungszwecken einsetzen.

Der Unterberater verwendet Maßnahmen, um die ESG-Merkmale des Portfolios mit dem MSCI Europe Index zu vergleichen. Dieser Index ist auch ein nützlicher Referenzwert, mit dem die Wertentwicklung verglichen werden kann. Der MSCI Europe Index wurde für diesen Zweck ausgewählt, da er eine gute repräsentative Auswahl von großen und mittleren Unternehmen in den europäischen Industrieländern (einschließlich des Vereinigten Königreichs) bietet. Entsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, ökologische oder soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

In Übereinstimmung mit seinen ESG-Anlagerichtlinien wird das Portfolio in einigen Sektoren und Unternehmen des Index nicht investieren.

Der Nettoinventarwert dieses Portfolios lautet auf Euro und Anlageentscheidungen erfolgen aus Sicht des Euro.

### Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Das Emerging Market ESG Equities Portfolio ist bestrebt, Kapitalzuwachs zu erzielen, und zwar durch Anlagen in einem konzentrierten Portfolio aus Aktien von Unternehmen mit starken oder sich verbessernden ESG-Eigenschaften (ESG = Umwelt, Soziales, Unternehmensführung).

Das Portfolio wird aktiv verwaltet und investiert vornehmlich in aktienähnliche Wertpapiere von Unternehmen in Schwellenländern. Für die Zwecke dieses Portfolios sind Unternehmen in Schwellenländern als Unternehmen mit Sitz und/oder bedeutender Geschäftstätigkeit in Schwellenländern zu verstehen. Des Weiteren kann das Portfolio in andere Wertpapiere, darunter andere Aktien, Depotscheine und Geldmarktinstrumente investieren.

Das Portfolio kann bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts über das China-Hong Kong Stock Connect-Programm in chinesische A-Aktien investieren.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Der Unterberater konzentriert sich auf die Auswahl von Unternehmen, die starke oder sich verbessernde ESG-Eigenschaften aufweisen, wie in den ESG-Anlagerichtlinien des Portfolios dargelegt. Diese Unternehmen sind aufgrund starker ESG-Praktiken führend in Nachhaltigkeitsfragen.

Der Unterberater verwendet Maßnahmen, um die ESG-Merkmale des Portfolios mit dem MSCI Emerging Markets Index zu vergleichen. Dieser Index ist auch ein nützlicher Referenzwert, mit dem die Wertentwicklung verglichen werden kann. Der MSCI Emerging Markets Index wurde für diesen Zweck ausgewählt, da er eine gute repräsentative Auswahl von großen und mittleren Unternehmen in den Schwellenländern bietet. Entsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, ökologische oder soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

In Übereinstimmung mit seinen ESG-Anlagerichtlinien wird das Portfolio in einigen Sektoren und Unternehmen des Index nicht investieren.

### Threadneedle (Lux) – European Social Bond

Das European Social Bond Portfolio strebt eine Gesamtrendite aus Erträgen und Kapitalzuwachs durch Anlagen in Schuldtitel an, von denen angenommen wird, dass sie sozial vorteilhafte Aktivitäten und Entwicklungen vorwiegend in Europa unterstützen oder finanzieren.

Zur Erreichung seines Ziels investiert das Portfolio hauptsächlich in alle Formen von Schuldtiteln, die ein Investment-Grade-Rating besitzen und von einer Regierung oder einer supranationalen, öffentlichen, privaten oder Freiwilligen- und/oder Wohltätigkeitsorganisation begeben wurden, unabhängig davon, ob diese einen festen, variablen oder indexgebundenen Zinssatz oder einen Nullkupon aufweisen. Diese Wertpapiere können gedeckte Anleihen, Agency-Anleihen, forderungsbesicherte und hypotheckenbesicherte Wertpapiere (wobei die forderungsbesicherten und hypotheckenbesicherten Wertpapiere 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios nicht übersteigen dürfen) und CoCo-Bonds (nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Portfolios) umfassen. Der Unterberater wird Schuldtitel auswählen, die nach der sozialen Rating-Methode, wie nachstehend beschrieben, als soziale Anlagen eingestuft wurden.

Daneben kann das Portfolio Barmittel, geldnahe Instrumente, Geldmarktinstrumente und andere Schuldtitel halten.

Ungeachtet des Vorstehenden können unter außergewöhnlichen Umständen gelegentlich maximal 10 % des Nettovermögens des Portfolios in Schuldtiteln gehalten werden, die sich nicht als soziale Anlagen gemäß der sozialen Rating-Methode qualifizieren oder nicht länger als solche betrachtet werden. Solche Schuldtitel müssen jedoch zumindest akzeptable ESG-Standards (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) erfüllen, wie vom Unterberater beurteilt. Diese umfassen alle breiteren, wesentlichen geschäftlichen Engagements der Emittenten, z. B. die Produktion von Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung oder kontroverse Waffen, oder Aktivitäten, die als Verletzung des UN Global Compact angesehen werden.

Das Portfolio wird nicht mehr als 10 % seines Nettovermögens in Schuldtitel investieren bzw. in Schuldtiteln halten, die ein Rating unter Investment-Grade besitzen, vorausgesetzt, dass solche Wertpapiere zum Kaufzeitpunkt kein niedrigeres Rating als B- oder gleichwertig von einer NRSRO aufweisen. Das Portfolio wird aktiv unter Bezug auf den ICE BofA Euro Non-Sovereign Index (50 %) und den ICE BofA Euro Corporate Euroland Issuers Index (50 %) verwaltet. Der Index ist im Großen und Ganzen repräsentativ für die Wertpapiere, in die das Portfolio investiert, und bietet einen geeigneten Ziel-Referenzwert, an dem die Portfoliopformance über einen bestimmten Zeitraum hinweg gemessen und bewertet wird. Entsprechend ist der Index nicht darauf ausgelegt, soziale Merkmale besonders zu berücksichtigen. Es liegt im Ermessen des Unterberaters, Anlagen mit anderen Gewichtungen als denen im Index sowie nicht im Index enthaltene Anlagen zu wählen, wobei das Portfolio erhebliche Abweichungen vom Index aufweisen kann.

Abweichungen vom Index, einschließlich Richtlinien zum Risikoniveau im Verhältnis zum Index, werden im Rahmen des Risikoüberwachungsprozesses des Unterberaters berücksichtigt, um sicherzustellen, dass das Gesamtrisiko weitgehend mit dem Index übereinstimmt. Im Einklang mit der aktiven Verwaltungsstrategie kann es zu signifikanten Abweichungen vom Index kommen.

## Förderung von ökologischen und sozialen Merkmalen

Die nachstehend aufgeführten Portfolios fördern ökologische und soziale Merkmale gemäß Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“ bzw. „SFDR“).

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies

Der Unterberater fördert ökologische und soziale Merkmale, indem er eine Reihe von Kennzahlen, die sich auf eine verantwortungsvolle Anlage beziehen, in den Entscheidungsprozess für Anlagen integriert.

Das Portfolio schneidet im Vergleich zum jeweiligen Index über rollierende Zwölfmonatszeiträume gut ab. Als Maßstab für die Bewertung wird das Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen – ein firmeneigenes Modell, das auf dem Rahmenwerk des Sustainability and Accounting Standards Board (SASB®) basiert. Dieses Modell identifiziert wesentliche Faktoren aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (Environmental, Social and Governance, ESG) in einer Vielzahl von Sektoren und gibt einen Einblick in den Fokus des Managements und die Standards der Betriebspraktiken eines Unternehmens. Der Unterberater ist der Ansicht, dass Unternehmen, die ESG-Risiken effektiv steuern, besser positioniert sind, um zukünftige Herausforderungen anzugehen und von unbekanntem und bekannten zukünftigen Geschäftsmöglichkeiten zu profitieren. Unternehmen, die bei den wichtigsten ESG-Kennzahlen führend sind, dürften gut aufgestellt sein, um einen Wettbewerbsvorteil zu erzielen und ihre langfristige Zukunft zu sichern.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Das Portfolio schließt außerdem Unternehmen aus, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien verstoßen (z. B. gegen den Global Compact der Vereinten Nationen). Unternehmen, bei denen Verstöße vorliegen, können vom Portfolio als zulässige Anlage bewertet werden, wenn der Unterberater der Ansicht ist, dass im Hinblick auf das zu haltende Unternehmen konkrete mildernde Umstände bestehen.

Der Unterberater stellt sicher, dass mindestens:

- 90 % der Aktienwerte, die von großen Unternehmen mit Sitz in Industrieländern ausgegeben werden; und
- 75 % der Aktienwerte, die von großen Unternehmen mit Sitz in Schwellenländern oder von kleinen und mittleren Unternehmen ausgegeben werden und vom Portfolio gehalten werden, im Hinblick auf die vorstehend genannten Kennzahlen bewertet werden.

Für die Zwecke dieser Prüfung werden kleine Unternehmen als Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung unter 5 Mrd. EUR, mittlere Unternehmen als Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung zwischen 5 Mrd. und 10 Mrd. EUR und große Unternehmen als Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung über 10 Mrd. EUR definiert. Um die Förderung von ökologischen und sozialen Merkmalen zu unterstützen und zu verbessern, sucht der Unterberater den proaktiven Dialog (Engagement) mit Unternehmen. Dabei wirkt er bei den Managementteams auf bessere Praktiken hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO<sub>2</sub>-Emissionen. Weitere Informationen zu den Anlagerichtlinien des Portfolios, einschließlich der Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating-Methode zur Bewertung der Wesentlichkeit und der Richtlinie zum Engagement, sind unter [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com) zu finden.

- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

Der Unterberater fördert ökologische und soziale Merkmale, indem er eine Reihe von Kennzahlen, die sich auf eine verantwortungsvolle Anlage beziehen, in den Entscheidungsprozess für Anlagen integriert.

Das Portfolio schneidet über rollierende Zwölfmonatszeiträume im Vergleich zum ICE BofA European Currency High Yield Excluding Subordinated Financials Constrained Index gut ab. Als Maßstab für die Bewertung wird das Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating herangezogen – ein firmeneigenes Modell, das auf dem Rahmenwerk des Sustainability and Accounting Standards Board (SASB®) basiert. Dieses Modell identifiziert wesentliche Faktoren aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (Environmental, Social and Governance, ESG) in einer Vielzahl von Sektoren und gibt einen Einblick in den Fokus des Managements und die Standards der Betriebspraktiken eines Unternehmens. Der Unterberater ist der Ansicht, dass Unternehmen, die ESG-Risiken effektiv steuern, besser positioniert sind, um zukünftige Herausforderungen anzugehen und von unbekanntem und bekannten zukünftigen Geschäftsmöglichkeiten zu profitieren. Unternehmen, die bei den wichtigsten ESG-Kennzahlen führend sind, dürften gut aufgestellt sein, um einen Wettbewerbsvorteil zu erzielen und ihre langfristige Zukunft zu sichern. Das Portfolio schließt außerdem Unternehmen aus, die gegen anerkannte internationale Standards und Prinzipien verstoßen (z. B. gegen den Global Compact der Vereinten Nationen). Unternehmen, bei denen Verstöße vorliegen, können vom Portfolio als zulässige Anlage bewertet werden, wenn der Unterberater der Ansicht ist, dass im Hinblick auf das zu haltende Unternehmen konkrete mildernde Umstände bestehen.

Der Unterberater stellt sicher, dass mindestens zwei Drittel der vom Portfolio gehaltenen festverzinslichen Wertpapiere nach den vorstehend genannten Kennzahlen bewertet werden.

Um die Förderung von ökologischen und sozialen Merkmalen zu unterstützen und zu verbessern, sucht der Unterberater den proaktiven Dialog (Engagement) mit Unternehmen. Dabei wirkt er bei den Managementteams auf bessere Praktiken hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO<sub>2</sub>-Emissionen. Weitere Informationen zu den Anlagerichtlinien des Portfolios, einschließlich der Columbia Threadneedle ESG Materiality Rating-Methode zur Bewertung der Wesentlichkeit und der Richtlinie zum Engagement, sind unter [columbiathreadneedle.com](http://columbiathreadneedle.com) zu finden.

## Förderung von ökologischen, sozialen und Unternehmensführungsmerkmalen

Die nachstehend aufgeführten Portfolios fördern ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale gemäß Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“ bzw. „SFDR“) fördern.

- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Die Anlagekriterien des Unterberaters für das Portfolio in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung („ESG“) sind in den ESG-Anlagerichtlinien des Portfolios dargelegt, die von Zeit zu Zeit geändert werden können. Diese sind spezifisch für das Portfolio und gehen über die normalen ethischen Praktiken des Unterberaters hinaus. Die ESG-Anlagerichtlinien des Portfolios sind auf Anfrage erhältlich. Die wesentlichen Bestandteile der ESG-Anlagerichtlinien sind:

1. Ein ESG-Ausschluss-Screening, das Unternehmen ausschließt, die die ESG-Anlagerichtlinien nicht erfüllen können. Dies dient beispielsweise dazu, Unternehmen auszuschließen, bei denen ein erheblicher Teil der Geschäftseinnahmen aus Aktivitäten wie der Herstellung umstrittener Waffen, Tabak oder Glücksspiel stammt, oder Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards und Grundsätze verstoßen;

2. Unternehmen, die gemäß diesem Ausschluss-Screening ausgeschlossen werden, können als geeignet für die Anlagen des Portfolios eingestuft werden, wenn sie nach Meinung des Unterberaters eindeutig eine Verbesserung ihrer ESG-Eigenschaften nachweisen. Dazu können beispielsweise Unternehmen gehören, die ihren Anteil an den Geschäftseinnahmen, die aus der oben beschriebenen Art von Aktivitäten stammen, aktiv reduzieren. Der Unterberater wird diese nichtfinanziellen Auswahlkriterien auf mindestens 90 % des Gesamtvermögens des Portfolios ohne zusätzliche liquide Mittel anwenden und er wird Messmethoden wie Ratings für verantwortungsvolle Anlagen und ein Ausschluss-Screening anwenden, um sicherzustellen, dass das ESG-Profil des Portfolios das des Indexes überschreitet.

## Förderung sozialer Merkmale

Das nachstehend aufgeführte Portfolio fördert soziale Merkmale gemäß Artikel 8 der EU-Verordnung 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („Offenlegungsverordnung“ bzw. „SFDR“) fördert.

- Threadneedle (Lux) – European Social Bond



## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

### Überblick über das Anlage- und das Beurteilungsverfahren

#### Anlageverfahren

Der Unterberater wählt die Schuldtitel basierend auf einer Kreditanalyse und dem sozialen Rating und der sozialen Kategorisierung im Rahmen der sozialen Rating-Methode („Social Rating Methodology“) aus. Die soziale Rating-Methode ist ein proprietäres Kategorisierungs- und Rating-Modell, das vom Unterberater entwickelt wurde und die sozialen Merkmale jeder potenziellen Anlage analysiert. Im Rahmen der Methode wird jede Anlage mittels eines zweigleisigen Verfahrens analysiert, das:

(i) die breite soziale Intensität und Intentionalität in Verbindung mit der Verwendung der Erlöse einer Anleihe beurteilt, um sie als Impact-Investment, eine Anlage mit einer Wirkung, als Entwicklungsfinanzierung oder als allgemeine Finanzierung einzustufen;

(ii) ein dreistufiges Beurteilungsmodell anwendet, das neun Aspekte des Schwerpunkts und der sozialen Ergebnisse, die einer Anleihe zuzuschreiben sind, untersucht und bewertet, im Hinblick auf Bereiche der sozialen Entwicklung wie bezahlbarer Wohnraum, Gesundheit und Wohlbefinden, Bildung, Arbeit, Zugang zu Dienstleistungen und wirtschaftliche Regeneration und Entwicklung, um eine Punktzahl abzuleiten, die vorbehaltlich einer De-minimis-Schwelle, ein soziales Rating von „unbedeutend“, „mittelmäßig“, „gut“ oder „stark“ ergibt. Eine Anleihe, deren Rating unterhalb der De-minimis-Schwelle liegt oder unter diese sinkt, unterliegt einer Überprüfung und Neueinstufung als allgemeine Finanzierung. Die Kategorisierung und Ratings werden anschließend vom Unterberater beim Portfolioaufbau verwendet.

Der Unterberater wird diese nichtfinanziellen Auswahlkriterien auf mindestens 90 % des Gesamtvermögens des Portfolios ohne zusätzliche liquide Mittel anwenden und er wird Messmethoden wie Ratings für verantwortungsvolle Anlagen und ein Ausschluss-Screening auf der Grundlage gesellschaftlicher Ergebnisse (social outcome-based exclusion screening) anwenden, um sicherzustellen, dass das ESG-Profil des Portfolios und sein Engagement in gesellschaftlichen Ergebnisthemen das des Indexes überschreitet.

#### Beurteilungs- und Analyseverfahren

Der Unterberater ist eine Partnerschaft mit INCO (<http://inco.co.com/>) eingegangen, einer auf Impact-Investment spezialisierten Organisation, um Unterstützung bei der Beurteilung und Berichterstattung über die sozialen Ergebnisse des Portfolios sowie Analysen zu für Impact-Investment relevanten Trends und Praktiken bereitzustellen. Zu diesem Zweck wurde ein sozialer Beratungsausschuss („Social Advisory Panel“ bzw. „SAP“) eingerichtet, der aus drei vom Unterberater ernannten und drei von INCO ernannten Mitgliedern besteht, um die Anwendung und Entwicklung der sozialen Rating-Methode zu überprüfen, zu überwachen und Ratschläge dazu zu geben, sowie um die tatsächlichen sozialen Ergebnisse von Anlagen zu überprüfen, die vom Unterberater getätigt wurden.

Eines der von INCO ernannten Mitglieder hat den Vorsitz des sozialen Beratungsausschusses inne. Ein jährlicher Bericht über die soziale Performance, der von INCO erstellt und vom sozialen Beratungsausschuss genehmigt wird, wird den Anlegern unter dem folgenden Link zur Verfügung gestellt: <https://www.columbiathreadneedle.lu>.

### Messung ökologischer und sozialer Anlageziele

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies

Wir verwalten das Portfolio aktiv im Einklang mit dem Ziel, ökologische und/oder soziale Merkmale im Sinne von Artikel 8 der SFDR zu fördern. Konkret bedeutet dies, dass wir das Portfolio aktiv auf diejenigen Unternehmen ausrichten, von denen angenommen wird, dass sie überdurchschnittlich gute ESG-Eigenschaften aufweisen, dass wir uns an alle relevanten Ausschlusskriterien halten und dass wir durch den Dialog mit Portfoliounternehmen sowie durch die Stimmrechtsausübung eine aktive Steuerungsfunktion ausüben.

Die Integration von Aspekten des verantwortungsvollen Investierens („Responsible Investment“, „RI“) in unsere fundamentale Unternehmensanalyse spielt eine zentrale Rolle bei der Art und Weise, wie wir das Portfolio verwalten und das Aktien-Anlageuniversum betrachten. Zudem gibt es uns ein umfassenderes Bild der Risiken, Chancen und Zukunftsaussichten der Unternehmen, in die wir investieren.

Wir nutzen unsere Möglichkeiten zur Stimmrechtsvertretung aktiv als eine wichtige Möglichkeit, um mit den Portfoliounternehmen in Kontakt zu treten. Im Jahr 2021 haben wir beispielsweise in über 70 Versammlungen über mehr als 500 Maßnahmen abgestimmt. Wir haben bei 100 % der zur Abstimmung stehenden Maßnahmen abgestimmt und keine einzige Abstimmung verpasst. Dieses Thema hat sich im Jahr 2022 fortgesetzt: Im ersten Quartal haben wir erneut bei 100 % der den Aktionären vorgelegten Anträge abgestimmt. Zudem folgen wir bei Abstimmungen nicht automatisch den Empfehlungen des Managements. Wir sind bereit, gegen die Empfehlungen der Unternehmensleitung oder des Beirats zu stimmen, wenn wir der Meinung sind, dass durch eine Ablehnung potenziell bessere langfristige Ergebnisse erzielt werden können. So haben wir beispielsweise auf 29 % der Aktionärsversammlungen im Jahr 2021 bei mindestens einem Antrag gegen die Unternehmensleitung abgestimmt.

Diese Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, die uns helfen, diejenigen Unternehmen zu identifizieren, die RI-Aspekte in ihr Geschäftsmodell integrieren und eine Verbesserung ihrer RI-Kennzahlen vorweisen können. Wenn wir den Eindruck haben, dass die Unternehmen nicht genug tun, setzen wir uns mit dem Management in Verbindung, um uns ein besseres Verständnis für sämtliche Probleme zu verschaffen und Anreize für positive Veränderungen zu setzen. Wir sehen unsere Rolle zunehmend darin, Managementteams zu einem besseren Standard in Bezug auf RI-Themen und RI-bezogene Offenlegungen zu führen.

Das Ergebnis dieses Ansatzes ist ein Portfolio, das eine positive ESG-Ausrichtung aufweist, sämtliche als umstritten eingestuft Unternehmen meidet und eine geringere Kohlenstoffintensität und einen geringeren Kohlenstoff-Fußabdruck als die Benchmark aufweist.

- Threadneedle (Lux) – Asia Equities

RI-Überlegungen fließen in unser Research ein, so dass wir uns ein umfassenderes Bild von den Risiken, Chancen und Zukunftsaussichten eines Unternehmens machen können. Unsere Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, während gezielte Dialoge mit Beteiligungsunternehmen und strategische Abstimmungen die Research-Erkenntnisse weiter verbessern und es uns ermöglichen, positive Veränderungen voranzutreiben.

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Das Team steht weiterhin mit den Portfoliounternehmen in Kontakt, um gute ESG-Praktiken besser zu verstehen und zu fördern. Im Rahmen der Stimmrechtsvertretung haben wir im Jahr 2021 auf 80 Sitzungen über mehr als 500 Maßnahmen abgestimmt. Wir haben über 100 % der zur Abstimmung stehenden Maßnahmen abgestimmt. Dieses Thema hat sich im Jahr 2022 fortgesetzt: Im ersten Quartal haben wir erneut bei 100 % der den Aktionären vorgelegten Anträge abgestimmt. Außerdem waren wir bereit, gegen das Management zu stimmen, um unsere Ansichten zu verdeutlichen und die Managementpraktiken positiv zu beeinflussen.

Das Ergebnis dieses Ansatzes ist ein Portfolio, das eine positive ESG-Ausrichtung aufweist, kein Engagement in umstrittenen Unternehmen enthält und niedrigere Werte bei der Kohlenstoffintensität und den Kohlenstoffemissionen als die Benchmark aufweist.

Die folgende Messung gilt für die nachstehenden Portfolios:

- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities

RI-Überlegungen fließen in unser Research ein, so dass wir uns ein umfassenderes Bild von den Risiken, Chancen und Zukunftsaussichten eines Unternehmens machen können. Unsere Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, während gezielte Dialoge mit Beteiligungsunternehmen und strategische Abstimmungen die Research-Erkenntnisse weiter verbessern und es uns ermöglichen, positive Veränderungen voranzutreiben. Das Ergebnis dieses disziplinierten Ansatzes sind Portfolios, die im Vergleich zu ihrem jeweiligen Index ein besseres ESG-Rating, einen geringeren Kohlenstoff-Fußabdruck und kein Engagement in umstrittenen Unternehmen aufweisen.

Während des Berichtszeitraums sind wir mit den Unternehmen im Portfolio in Kontakt geblieben, um gute ESG-Praktiken zu verstehen und zu fördern. Wir haben für alle von uns gehaltenen Aktien abgestimmt und in einer erheblichen Anzahl von Fällen gegen die Unternehmensleitung gestimmt, um unsere Ansichten zu verdeutlichen und einen starken Einfluss auf das Verhalten des Managements auszuüben.

Die folgende Messung gilt für die nachstehenden Portfolios:

- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies

RI-Überlegungen fließen in unser Research ein, so dass wir uns ein umfassenderes Bild von den Risiken, Chancen und Zukunftsaussichten eines Unternehmens machen können. Unsere Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, während gezielte Dialoge mit Beteiligungsunternehmen und strategische Abstimmungen die Research-Erkenntnisse weiter verbessern und es uns ermöglichen, positive Veränderungen voranzutreiben. Um sicherzustellen, dass wir ökologische und soziale Merkmale fördern, überwachen wir das ESG Materiality Rating, das MSCI ESG Rating und die Kohlenstoffemissionen auf Portfolio- und Wertpapiererebene. Außerdem treten wir aktiv mit Unternehmen in Kontakt, um mit Unterstützung unseres Teams für verantwortungsvolle Anlagen das starke/besser werdende ESG-Profil eines Unternehmens zu überwachen. Das Ergebnis dieses disziplinierten Ansatzes ist ein Portfolio, das im Vergleich zum Index ein besseres ESG-Rating, einen geringeren Kohlenstoff-Fußabdruck und kein Engagement in umstrittenen Unternehmen aufweist.

- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income

RI-Überlegungen fließen in unser Research ein, so dass wir uns ein umfassenderes Bild von den Risiken, Chancen und Zukunftsaussichten eines Unternehmens machen können. Unsere Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, während gezielte Dialoge mit Beteiligungsunternehmen und strategische Abstimmungen die Research-Erkenntnisse weiter verbessern und es uns ermöglichen, positive Veränderungen voranzutreiben. Um sicherzustellen, dass wir ökologische und soziale Merkmale fördern, überwachen wir das ESG Materiality Rating, das MSCI ESG Rating und die Kohlenstoffemissionen auf Portfolio- und Wertpapiererebene. Außerdem treten wir aktiv mit Unternehmen in Kontakt, um mit Unterstützung unseres Teams für verantwortungsvolle Anlagen das starke/besser werdende ESG-Profil eines Unternehmens zu überwachen. Das Ergebnis dieses disziplinierten Ansatzes ist ein Portfolio, das im Vergleich zum Index ein besseres ESG-Rating und kein Engagement in umstrittenen Unternehmen aufweist.

- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond

Wir fördern ökologische und soziale Merkmale, indem wir eine Reihe von Kennzahlen, die sich auf eine verantwortungsvolle Anlage beziehen, in den Entscheidungsprozess für Anlagen integrieren.

HY-Analysten bewerten und überwachen den ESG-Ansatz und die ESG-Praktiken von Unternehmen, wobei sie eine Reihe von Quellen und Kennzahlen als integralen Bestandteil ihres Research hinzuziehen und bei Bedarf auf die Expertise des RI-Teams zurückgreifen. Die ESG-Bewertung wird in Research-Berichten präsentiert, die bei Anlageentscheidungen des Teams berücksichtigt werden.

ESG-Risiken werden auf Portfolioebene anhand des ESG Materiality Ratings von CTI berücksichtigt. Dabei handelt es sich um ein firmeneigenes Modell, das auf dem Rahmenwerk des Sustainability and Accounting Standards Board (SASB®) basiert. Dieses Modell identifiziert wesentliche Faktoren aus den Bereichen Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (Environmental, Social and Governance, ESG) in einer Vielzahl von Sektoren und gibt einen Einblick in den Fokus des Managements und die Standards der Betriebspraktiken eines Unternehmens. Wir erwarten, dass das Portfolio über rollierende Zwölfmonatszeiträume bei dieser Kennzahl besser abschneidet als die Benchmark.

Um die Förderung von ökologischen und sozialen Merkmalen zu unterstützen und zu verbessern, suchen wir den proaktiven Dialog (Engagement) mit Unternehmen. Dabei wirken wir bei den Managementteams auf bessere Praktiken hin, zum Beispiel bei Fragen im Zusammenhang mit CO<sub>2</sub>-Emissionen.

Bei der Bewertung der Praxisstandards eines Unternehmens verwenden wir ein Screening von Unternehmen, die gegen anerkannte internationale Standards verstoßen, wie z. B.: Verstöße gegen den UN Global Compact, die ILO oder die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte sowie schwerwiegende und systemische Kontroversen (z. B. in Bezug auf Menschen- und Arbeitnehmerrechte, Umwelt, Bestechung, Betrug, Korruption, falsche Finanzangaben, Kontroversen in Verbraucherfragen).

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

Das für die Einhaltung von Mandaten zuständige Team führt vor und nach einer Transaktion automatisierte Überprüfungen anhand einer Ausschlussliste von Unternehmen durch, die gegen anerkannte internationale Standards verstoßen. Dabei werden Screening-Daten von MSCI zugrunde gelegt.

- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Wir sind davon überzeugt, dass ein Fokus auf ESG-Aspekte unerlässlich ist, um einen Wettbewerbsvorteil aufzubauen und die langfristige Zukunft eines Unternehmens zu sichern. Dies hilft uns, sowohl die Risiken einer Anlage in einem Unternehmen als auch die potenziellen Renditechancen zu erkennen. Unsere Analyse wird durch eine Reihe von RI-Analysen unterstützt, während gezielte Dialoge mit Beteiligungsunternehmen und strategische Abstimmungen die Research-Erkenntnisse weiter verbessern und es uns ermöglichen, positive Veränderungen voranzutreiben.

Das Team steht weiterhin mit den Portfoliounternehmen in Kontakt, um gute ESG-Praktiken besser zu verstehen und zu fördern. Im Rahmen der Stimmrechtsvertretung haben wir im Jahr 2021 auf 80 Sitzungen über mehr als 500 Maßnahmen abgestimmt. Wir haben über 100 % der zur Abstimmung stehenden Maßnahmen abgestimmt. Dieses Thema hat sich im Jahr 2022 fortgesetzt: Im ersten Quartal haben wir erneut bei 100 % der den Aktionären vorgelegten Anträge abgestimmt. Außerdem waren wir bereit, gegen das Management zu stimmen, um unsere Ansichten zu verdeutlichen und die Managementpraktiken positiv zu beeinflussen.

Das Ergebnis dieses Ansatzes ist ein Portfolio, das eine positive ESG-Ausrichtung aufweist, sämtliche als umstritten eingestuft Unternehmen meidet und niedrigere Werte bei der Kohlenstoffintensität und den Kohlenstoffemissionen als die Benchmark aufweist.

- Threadneedle (Lux) – European Social Bond

Das Portfolio konzentriert sich auf eine Hierarchie von sieben sozialen Ergebnisbereichen, die zur Ermittlung der Auswirkungen herangezogen werden. Alle Beteiligungen des Portfolios verfolgen mindestens eines dieser sozialen Ziele und haben dies durchgängig seit der Auflegung des Portfolios getan. Darüber hinaus erhalten alle Anleihen ein soziales Rating, indem ihre soziale Intention und Intensität bewertet wird. Im Rahmen der sozialen Bewertung müssen die Analysten auch etwaige ESG- oder Reputationsrisiken darlegen, die Auswirkungen auf die soziale Glaubwürdigkeit der Anlage haben könnten, und prüfen, ob eine Aufnahme in das Portfolio zu empfehlen ist. Diese Beurteilungen werden vom unabhängigen Sozialpartner des Portfolios überprüft, der Teil des sozialen Beratungsausschusses ist, das die Anlagen des Portfolios unter sozialen Gesichtspunkten überprüft, berät und überwacht. Das Ergebnis dieses disziplinierten Ansatzes ist eine über Unternehmensanleihen mit Investment-Grade-Rating erzielte Rendite in Verbindung mit sozialem Einfluss, vor allem in Europa. Die Positionen des Portfolios werden als Impact-Investments, Anlagen mit Wirkung und Entwicklungsfinanzierungsinvestitionen eingestuft, die jeweils auf soziale Ergebnisse abzielen. Darüber hinaus werden Teile des Index ausgeschlossen, in denen Unternehmen unangemessenen Geschäftsaktivitäten nachgehen, z. B. in den Bereichen Tabakwaren, Kernenergie oder Waffenherstellung.

## EU-Taxonomie-Verordnung

- Threadneedle (Lux) – American Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Asia Equities
- Threadneedle (Lux) – European Select
- Threadneedle (Lux) – European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Global Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Global Focus
- Threadneedle (Lux) – Global Select
- Threadneedle (Lux) – Global Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – Pan European Smaller Companies
- Threadneedle (Lux) – European High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – Pan European ESG Equities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market ESG Equities

Die Verordnung (EU) 2020/852 über die Schaffung eines Rahmens zur Erleichterung nachhaltiger Investitionen (die „EU-Taxonomie-Verordnung“) legt Kriterien fest, anhand derer bestimmt werden kann, ob eine Wirtschaftstätigkeit in Bezug auf sechs Umweltziele als ökologisch nachhaltig einzustufen ist.

Die vorstehend genannten Portfolios fördern ökologische Merkmale und fallen daher in den Anwendungsbereich von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“). Die Portfolios sind daher gemäß der EU-Taxonomie-Verordnung verpflichtet, offenzulegen, wie und in welchem Umfang die dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen wirtschaftliche Tätigkeiten betreffen, die als ökologisch nachhaltig eingestuft sind.

Die den Portfolios zugrunde liegenden Anlagen berücksichtigen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten derzeit nicht.

Darüber hinaus gilt der Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen gemäß der EU-Taxonomie-Verordnung nur für die einem Finanzprodukt zugrunde liegenden Anlagen, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Daher gilt der Grundsatz der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen für keine der Anlagen der Portfolios. Die Portfolios fallen daher derzeit nicht in den Anwendungsbereich der EU-Taxonomie-Verordnung.

Threadneedle (Lux) – European Social Bond fördert soziale Merkmale und fällt daher in den Anwendungsbereich von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“).

Die gemäß der EU-Taxonomie-Verordnung zu machenden Angaben gelten nicht für diese Strategie, da sie nur soziale Merkmale fördert.

- Threadneedle (Lux) – American
- Threadneedle (Lux) – American Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – American Select

## Offenlegungsverordnung (SFDR) (ungeprüft)

(Fortsetzung)

- Threadneedle (Lux) – Asia Contrarian Equity
- Threadneedle (Lux) – Asian Equity Income
- Threadneedle (Lux) – Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Corporate Bonds
- Threadneedle (Lux) – Emerging Market Debt
- Threadneedle (Lux) – Enhanced Commodities
- Threadneedle (Lux) – Euro Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – European Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – European Short-Term High Yield Bond
- Threadneedle (Lux) – European Strategic Bond
- Threadneedle (Lux) – Flexible Asian Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Corporate Bond
- Threadneedle (Lux) – Global Dynamic Real Return
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Equities
- Threadneedle (Lux) – Global Emerging Market Short-Term Bonds
- Threadneedle (Lux) – Global Extended Alpha
- Threadneedle (Lux) – Global Investment Grade Credit Opportunities
- Threadneedle (Lux) – Global Multi Asset Income
- Threadneedle (Lux) – Global Technology
- Threadneedle (Lux) – Pan European Absolute Alpha
- Threadneedle (Lux) – Pan European Equity Dividend
- Threadneedle (Lux) – Pan European Small Cap Opportunities
- Threadneedle (Lux) – UK Equities
- Threadneedle (Lux) – UK Equity Income
- Threadneedle (Lux) – US Contrarian Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US Disciplined Core Equities
- Threadneedle (Lux) – US High Yield Bond

Jedes der vorstehenden Portfolios bezieht Nachhaltigkeitsrisiken ein und fällt daher in den Anwendungsbereich von Artikel 6 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“). Gemäß der EU-Taxonomie-Verordnung muss für jedes dieser Portfolios angegeben werden, dass die dem Portfolio zugrunde liegenden Anlagen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten nicht berücksichtigen.

## Adressverzeichnis

### Eingetragener Firmensitz

31 Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### Anlageberater

Threadneedle Management Luxembourg S.A.

### Unterbevollmächtigte<sup>1</sup>:

Columbia Management  
Investment Advisers, LLC  
290 Congress Street  
Boston, MA 02110  
Vereinigte Staaten

Threadneedle Asset  
Management Limited  
Cannon Place  
78 Cannon Street  
London EC4N 6AG  
Vereinigtes Königreich

### Verwaltungsgesellschaft

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Threadneedle (Lux) - US High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market ESG Equities<sup>2</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Equities<sup>2</sup>  
Threadneedle (Lux) - US Contrarian Core Equities  
Threadneedle (Lux) - US Disciplined Core Equities  
Threadneedle (Lux) - Global Technology  
  
Threadneedle (Lux) - Global Corporate Bond<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - European Corporate Bond  
Threadneedle (Lux) - European High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - European Short-Term High Yield Bond  
Threadneedle (Lux) - European Social Bond  
Threadneedle (Lux) - European Strategic Bond  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Corporate Bonds<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Emerging Market Debt<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Emerging Market Short-Term Bonds<sup>3</sup>  
Threadneedle (Lux) - Flexible Asian Bond<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Euro Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Dynamic Real Return  
Threadneedle (Lux) - Global Multi Asset Income<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Global Focus  
Threadneedle (Lux) - Global Equity Income  
Threadneedle (Lux) - Global Select  
Threadneedle (Lux) - Global Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - American<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Select<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - American Smaller Companies<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Asia Equities<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - Pan European ESG Equities<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Pan European Equity Dividend  
Threadneedle (Lux) - Pan European Small Cap Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - European Select  
Threadneedle (Lux) - European Smaller Companies  
Threadneedle (Lux) - Asian Equity Income<sup>4</sup>  
Threadneedle (Lux) - UK Equities  
Threadneedle (Lux) - UK Equity Income  
Threadneedle (Lux) - American Absolute Alpha<sup>5</sup>  
Threadneedle (Lux) - Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Global Investment Grade Credit Opportunities  
Threadneedle (Lux) - Pan European Absolute Alpha  
Threadneedle (Lux) - American Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Global Extended Alpha  
Threadneedle (Lux) - Enhanced Commodities

## Adressverzeichnis

(Fortsetzung)

Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited 3 Killiney Road #07-07 Winsland House 1 Singapur 239519 Singapur	Threadneedle (Lux) - Asia Contrarian Equity <sup>6</sup>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------

STANLIB Asset Management (Pty.) Limited 17 Melrose Boulevard Melrose Arch 2196 Johannesburg Südafrika	Threadneedle (Lux) - STANLIB Africa Equity <sup>7</sup>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------

<sup>1</sup>Unter der Verantwortlichkeit und Aufsicht von Threadneedle Management Luxembourg S.A.

<sup>2</sup>Threadneedle Asset Management Limited gibt Columbia Management Investment Advisers, LLC Anlageempfehlungen und erteilt der Columbia Management Investment Advisers, LLC daher eine auf Research gestützte Anlageberatung.

<sup>3</sup>Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich seiner eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Columbia Management Investment Advisers, LLC delegieren.

<sup>4</sup>Threadneedle Asset Management Limited kann vorbehaltlich ihrer eigenen Haftung die diskretionäre Anlageverwaltung eines Teils des Portfoliovermögens an Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited delegieren.

<sup>5</sup>Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Asset Management Limited Anlageempfehlungen und erteilt der Threadneedle Asset Management Limited daher eine auf Research gestützte Anlageberatung.

<sup>6</sup>Columbia Management Investment Advisers, LLC gibt Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited Anlageempfehlungen und stellt daher für Threadneedle Investments Singapore (Pte.) Limited eine auf Analysen gestützte Anlageberatung bereit.

<sup>7</sup>Siehe Erläuterung 1 auf Seite 236.

## Adressverzeichnis

(Fortsetzung)

### **Verwahr-, Domizil-, Verwaltungs- und Zahlstelle**

Citibank Europe plc, Zweigniederlassung Luxemburg  
31, Z.A. Bourmicht  
L-8070 Bertrange  
Großherzogtum Luxemburg

### **Register- und Transferstelle**

International Financial Data Services (Luxembourg) S.A.  
47, Avenue John F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### **Vertriebsstelle (an verschiedene Vertriebsgesellschaften delegiert)**

Threadneedle Management Luxembourg S.A.  
44, rue de la Vallée  
L-2661 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

### **Vertreter und Zahlstellen**

#### **In Österreich**

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG  
Graben 21  
A-1010 Wien  
Österreich

#### **In Belgien**

CACEIS Belgium S.A  
Avenue du Port 86 C b 320  
B-1000 Brüssel  
Belgien

#### **In Frankreich**

CACEIS Bank France  
1/3 Place Valhubert  
F-75206 Paris Cedex 13  
Frankreich

#### **In Deutschland**

J.P. Morgan AG  
Junghofstraße 14  
D-60311 Frankfurt am Main  
Deutschland

#### **In Hongkong**

HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited  
17/F Tower 2 & 3 HSBC Centre  
1 Sham Mong Road  
Kowloon  
Hongkong

#### **In der Schweiz**

RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette  
Succursale de Zurich  
Bleicherweg 7  
CH-8027 Zürich  
Schweiz

#### **Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, *Société coopérative*  
2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443  
L-1014 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

#### **Rechtsberater in Luxemburg**

Linklaters LLP, Luxemburg  
35 Avenue John F. Kennedy, B.P.  
L-1011 Luxemburg  
Großherzogtum Luxemburg

Weitere Informationen finden Sie auf unserer Website: [columbiathreadneedle.com](https://columbiathreadneedle.com)



**Herausgegeben von Threadneedle Management Luxembourg S.A.** Beim luxemburgischen Registre de Commerce et des Societes (Handels- und Gesellschaftsregister) unter der Nummer B 110242 eingetragen, 44, rue de la Vallée, L-2661 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg. Im Vereinigten Königreich herausgegeben von Threadneedle Asset Management Limited (TAML) eingetragen in England und Wales unter der Registernummer 573204, Cannon Place, 78 Cannon Street, London EC4N 6AG, Vereinigtes Königreich. Im Vereinigten Königreich von der Financial Conduct Authority autorisiert und beaufsichtigt. Columbia Threadneedle Investments ist der globaler Markenname der Columbia and Threadneedle-Unternehmensgruppe. [columbiathreadneedle.com](https://columbiathreadneedle.com)

436727